

Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің қызметін реттеу мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2022 жылғы 14 ақпандағы № 5 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2022 жылғы 21 ақпанда № 26863 болып тіркелді.

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің Басқармасы ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:

1. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің қызметін реттеу мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі (бұдан әрі – Тізбе) 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 Республикасы Стратегиялық
жоспарлау және реформалар агенттігінің
Ұлттық статистика бюросы

"КЕЛІСІЛДІ"

Қазақстан Республикасының
Ұлттық Банкі

Қазақстан Республикасының
Қаржы нарығын реттеу және
дамыту Агенттігінің
Басқармасының
2022 жылғы 14 ақпандағы

Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің қызметін реттеу мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі

1. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 07.06.2023 № 41 (01.07.2023 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен

2. "Инвестициялық портфельді басқарушының ірі қатысушысы инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициенттерін қолдау жөнінде қолданатын шаралар туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 2 қарашадағы № 208 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 16040 болып тіркелген) мынадай өзгеріс енгізілсін:

1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"1. Инвестициялық портфельді басқарушының (бұдан әрі – Басқарушы) ірі қатысушысы инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициенттерін қолдау жөнінде мынадай шаралар белгіленсін:

1) ірі қатысушының сақтауы үшін міндетті Басқарушының меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициенттерін қолдау жөнінде шаралар қолданудың талаптары мен тәртібін белгілейтін ішкі құжаттарды Басқарушының заңды тұлға болып табылатын ірі қатысушысының әзірлеуі және бекітуі;

2) "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 2014 жылғы 3 ақпандағы № 79 қаулысының (бұдан әрі – № 79 қаулы) (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген, 2018 жылғы 12 маусымда Нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде жарияланған) 1-тармағының 1) тармақшасының екінші абзацында белгіленген Басқарушының меншік капиталының жеткіліктілігі коэффициенттерінің қажетті мәнін тұрақты түрде қамтамасыз ету;

3) Басқарушының меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициенттерінің № 79 қаулының 1-тармағының екінші абзацында белгіленген қажетті мәнін шұғыл қамтамасыз ету."

3. "Орталық депозитарийге арналған тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 28 желтоқсандағы № 318 қаулысына (Нормативтік

құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 18180 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Орталық депозитарийге арналған тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларында:

2-қосымша Тізбеге 2-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

4-қосымша Тізбеге 3-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

5-қосымша тізбеге 4-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

6-қосымша тізбеге 5-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын.

Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығы
субъектілерінің қызметін реттеу
мәселелері бойынша өзгерістер
енгізілетін нормативтік
құқықтық актілерінің тізбесіне
1-қосымша

Ескерту. 2-қосымшаның күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 07.06.2023 № 41 (01.07.2023 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығы
субъектілерінің қызметін реттеу
мәселелері бойынша өзгерістер
енгізілетін нормативтік
құқықтық актілерінің тізбесіне
2-қосымша

Орталық депозитарийге
арналған тәуекелдерді басқару
және ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру қағидаларына
2-қосымша

Әкімшілік деректерді жинауға арналған нысан

Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті органға ұсынылады.

Әкімшілік деректердің нысаны <http://finreg.kz> интернет-ресурсына орналастырылған

Тәуекелдерді басқару жөніндегі қызмет туралы ақпарат

Әкімшілік деректер нысанының индексі: RISK_TISR1

Кезеңділігі: жартыжылдық негізде

Есепті кезең: 20__ жылғы "___" _____ жағдай бойынша

Ақпаратты ұсынатын тұлғалар тобы: бағалы қағаздардың орталық депозитарийі

Ұсыну мерзімі: есепті жартыжылдықтан кейінгі айдың 5 (бесінші) жұмыс күнінен кешіктірмей

		Тәуекел оқиғасының пайда болуы
--	--	--------------------------------

№	Тәуекел оқиғасының сипаттамасы	Тәуекел түрі (түрлері)	Еселігі	Жағдайлар саны					
				ай 1	ай 2	ай 3	ай 4	ай 5	ай 6
1	2	3	4	5					
1.									
2.									
3.									

кестенің жалғасы:

Тәуекелдердің пайда болу себептерін сипаттау	Тәуекелдердің пайда болу нәтижесінде салдардың (залалдардың) нысаны мен мөлшері	Есепті кезеңде пайда болған тәуекелдерді төмендету мақсатында қабылданған шаралар туралы ақпарат	
		шаралар	оларды іске асыру мерзімдері
6	7	8	9

Атауы _____

Мекенжайы _____

Телефон _____

Электрондық пошта мекенжайы _____

Бірінші басшы немесе ол есепке қол қоюға уәкілеттік берген адам

_____ тегі, аты және әкесінің аты (ол бар болса) қолы, телефон
Тәуекелдерді басқару бөлімшесінің басшысы

_____ тегі, аты және әкесінің аты (ол бар болса) қолы, телефон
Ішкі аудит қызметінің басшысы

_____ тегі, аты және әкесінің аты (болған жағдайда) қолы, телефон
Күні 20__ жылғы " ____ " _____

Тәуекелдерді басқару
жөніндегі қызмет туралы
ақпарат нысанына
қосымша

Әкімшілік деректер нысанын толтыру бойынша түсіндірме

Тәуекелдерді басқару жөніндегі қызмет туралы ақпарат (индексі - RISK_TISR1, кезеңділігі - жартыжылдық негізде)

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы түсіндірме (бұдан әрі - Түсіндірме) "Тәуекелдерді басқару жөніндегі қызмет туралы ақпарат" нысанын (бұдан әрі - Нысан) толтыру бойынша талаптарды айқындайды.

2. Нысан "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 52-бабына сәйкес әзірленді.

3. Нысанды орталық депозитарий жартыжылдық негізде жасайды және есепті жартыжылдыққа толтырылады.

4. Нысанға бірінші басшы немесе есепке қол қоюға уәкілетті адам, тәуекелдерді басқару бөлімшесінің басшысы, ішкі аудит қызметінің басшысы қол қояды.

2-тарау. Нысанды толтыру бойынша түсіндірме

5. 2-бағанда орталық депозитарийдің қызметінде есепті кезең ішінде туындаған тәуекел оқиғалары сипатталады.

6. 3-бағанда Нысанның 2-бағанында көрсетілген тәуекел оқиғасына жататын тәуекел түрі (түрлері) көрсетіледі.

7. 4-бағанда Нысанның 2-бағанында көрсетілген тәуекел оқиғасының орталық депозитарий қызметінің басынан бастап кезең ішіндегі еселігі (бірінші, қайталану) көрсетіледі.

8. 5-бағанда Нысанның 2-бағанында көрсетілген есепті кезеңдегі тәуекел оқиғаның туындау жағдайларының саны ай сайын көрсетіледі.

9. 6-бағанда орталық депозитарий қызметінде есепті кезең ішінде Нысанның 2-бағанында көрсетілген тәуекел оқиғасының туындау себептері көрсетіледі.

10. 7-бағанда Нысанның 2-бағанында көрсетілген тәуекел оқиғасының туындауы нәтижесінде салдардың (залалдардың), оның ішінде залалдардың түрі және мөлшері көрсетіледі.

11. 8-бағанда орталық депозитарий қызметінде есепті кезең ішінде туындаған тәуекелдерді төмендету бойынша орталық депозитарий қабылдаған шаралар туралы ақпарат көрсетіледі.

12. 9-бағанда Нысанның 8-бағанында көрсетілген шараларды іске асыру мерзімдері туралы ақпарат көрсетіледі.

Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығы
субъектілерінің қызметін реттеу
мәселелері бойынша өзгерістер
енгізілетін нормативтік
құқықтық актілерінің тізбесіне
3-қосымша

Орталық депозитарийге
арналған тәуекелдерді басқару
және ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру қағидаларына
4-қосымша

Тәуекелді сәйкестендіруге, өлшеуге, бағалауға, бақылауға және мониторингтеуге қойылатын талаптар

1. Орталық депозитарий өз қызметінде тәуекелдердің мынадай түрлерін сәйкестендіреді:

- 1) операциялық тәуекелдер;
- 2) құқықтық тәуекелдер;
- 3) бедел тәуекелдері;
- 4) нарықтық (баға, валюталық және пайыздық) тәуекелдер;
- 5) кредиттік тәуекелдер;
- 6) өтімділікті жоғалту тәуекелі;

7) орталық депозитарийдің тәуекелдерді басқару саясатына сәйкес айқындалатын тәуекелдер.

2. Операциялық тәуекелдерге:

1) жауапкершілікті бөлуді, есеп беру мен басқару құрылымын қоса алғанда, орталық депозитарийдің айқындалмаған және тиімсіз ұйымдық құрылымына;

2) ақпараттық технологиялар саласындағы тиімсіз стратегияларға, саясатқа және (немесе) стандарттарға, бағдарламалық қамтамасыз етуді пайдаланудағы кемшіліктерге;

3) орталық депозитарий қызметкерлерін тиімсіз басқаруға және (немесе) оның білікті емес штатына;

4) есепке алу мен тізілімдердің жүйелерін рұқсатсыз пайдалануға;

5) орталық депозитарий қызметін жүзеге асыру процестерін тиімді құру жеткіліксіздігіне не ішкі ережелерді сақтауға нашар бақылау жасауға байланысты тәуекелдерді;

6) орталық депозитарийдің қызметіне күтілмеген немесе бақыланбаған сыртқы ықпал ету факторларының әсеріне;

7) орталық депозитарийдің қызметін регламенттейтін ішкі құжаттарда кемшіліктер мен қателердің болуына;

8) эмиссиялық бағалы қағаздар мен өзге қаржы құралдары бойынша құқықтарды есепке алу процесін, қаржы құралдарындағы мәмілелерді, есеп айрысуларды тіркеу, орталық депозитарийде жасалатын жекелеген операцияларды автоматтандыруды және есепке алу және тізілімдер жүйелерінде қамтылған мәліметтерді көрсету және көрсетілген жүйелерде операциялар жүргізу процесін бұзуға;

9) орталық депозитарий депоненттері және олардың клиенттері, бағалы қағаздардың эмитенттері және (немесе) ұстаушылары, қор биржасы ұсынатын конфиденциалды ақпаратты заңсыз пайдалануға;

10) орталық депозитарий органдары және олардың бөлімшелері арасында мүдделер қақтығысының туындауына;

11) ақпаратты жинауға, енгізуге, сақтауға және таратуға байланысты қателердің туындауына;

12) есепке алу және тізілімдер жүйесін, сондай-ақ пайдаланылатын ақпараттық және коммуникациялық жүйелер мен технологияны қоса алғанда, орталық депозитарийдің бағдарламалық-техникалық қамтамасыз ету жұмысындағы қателер мен іркілістердің туындау ықтималдылығына;

13) орталық депозитарий қызметі процесінде, оның ішінде эмиссиялық бағалы қағаздар және өзге қаржы құралдары бойынша құқықтарды есепке алу процесін ұйымдастыруды, қаржы құралдарындағы есеп айырысуларды, бағалы қағаздар ұстаушыларының тізілімдері жүйесіндегі мәліметтердің көрсетілуін қоса алғанда, жетілдірілмеген технологияларды пайдалану, жүйелік басқару функцияларын орындау салдарынан зиянның туындау ықтималдылығына;

14) есепке алу мен тізілімдердің жүйелеріне деректерді енгізу мен өзгерту кезінде қателердің туындауына;

15) орталық депозитарий әлеуетті тәуекелдер ретінде сәйкестендіретін өзге жағдайларға байланысты тәуекелдер кіреді.

3. Операциялық тәуекелдерді өлшеу, бағалау, бақылау және мониторингтеу кезінде орталық депозитарий мынадай әдістердің біреуін немесе бірнешеуін қолданады:

- 1) тәуекелдің негізгі индикаторларын пайдалану;
- 2) тәуекелдердің матрицаларын қалыптастыру;
- 3) зиян бойынша ішкі деректерді жинау мен талдауды жүзеге асыру (зиян бойынша дерекқор жүргізу);
- 4) бизнес-процестердің сипаттамасы (регламентациялау);
- 5) аудиторлық тексерулердің нәтижелерін пайдалану.

Операциялық тәуекелдерді өлшеу, бағалау, бақылау және мониторингтеу әдістерін таңдау тәртібі орталық депозитарийдің операциялық тәуекелдерді басқару мәселелері бойынша ішкі құжатында белгіленеді.

4. Құқықтық қамтамасыз ету бөлімшесі (заң бөлімшесі) тәуекелдерді басқару бөлімшесімен бірлесіп орталық депозитарийдің қызметін реттейтін Қазақстан Республикасы заңнамасының талаптарын орталық депозитарийдің бұзуы салдарынан туындайтын құқықтық тәуекелдерді бақылауды және мониторингтеуді:

1) орталық депозитарий қызметінің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы және акционерлік қоғамдар туралы заңнамасына, орталық депозитарийдің ішкі қағидаларына және шарттық қатынастар талаптарына сәйкес келуіне бақылауды жүзеге асыру;

2) орталық депозитарий қызметкерлерін тұрақты негізде орталық депозитарийдің қызметін реттейтін Қазақстан Республикасының заңнамасымен таныстыру;

3) орталық депозитарийдің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы және акционерлік қоғамдар туралы заңнамасында белгіленген талаптарды орындамау тәуекелдерінің туындауын бағалауды жүргізу арқылы қамтамасыз етеді.

5. Жұртшылықпен байланыс бөлімшесі тәуекелдерді басқару бөлімшесімен бірлесіп :

1) мемлекеттік органдар өкілдерінің, бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің, қаржы нарығын талдаушылардың орталық депозитарийдің қызметіне және (немесе) оның ағымдағы жай-күйіне қатысты қарама-қайшы және (немесе) теріс мәлімдемелері;

2) ресми емес дереккөздерден алынған ақпараттың рөлін күшейту, орталық депозитарий қызметкерлерінің, сол сияқты үшінші тұлғалардың шындыққа сәйкес келмейтін теріс ақпаратты таратуы;

3) орталық депозитарий туралы теріс ақпаратқа бұқаралық ақпарат құралдарының қызығушылығының өсуі;

4) орталық депозитарийдің беделіне теріс әсер ететін факторлар салдарынан туындайтын бедел тәуекелдерін бақылауды, мониторингтеуді, сол сияқты барынша азайтуды қамтамасыз етеді.

6. Тәуекелдерді басқару бөлімшесі мүдделі бөлімшелермен бірлесіп мерзімдік негізде, бірақ жылына кемінде бір рет тәуекелдердің әлеуетті қаупінің көздерін анықтау және стрестік жағдайлардың іске асырылуы салдарынан ықтимал күтілетін зияндарды бағалау үшін стресс-тестинг жүргізеді.

Стресс-тестинг сценарийлерін Орталық депозитарийдің басқармасы бекітеді.

Әдіснаманы және есептердің нысандарын қоса алғанда, стресс-тестингті жүргізу тәртібіне қойылатын талаптар орталық депозитарийдің ішкі құжаттарымен белгіленеді.

Басқарма қажеттілігіне қарай (бірақ жылына кемінде бір рет) стресс-тестинг сценарийлерін, оның ішінде жалпы экономикалық және нарықтық конъюнктураның, орталық депозитарийдің тәуекел бейінінің өзгеруіне байланысты қайта қарауды жүзеге асырады.

7. Мыналар орталық депозитарийде тәуекелді бақылаудың және мониторингтеудің мақсаты болып табылады:

1) сәйкес келтірілмеген тәуекелдер мен қауіпті уақтылы анықтау;

2) тәуекелдер көрсеткішінің рұқсат етілген ең жоғары мәндерін бағалау сапасын арттыру;

3) тәуекелдерді басқарудың баламалы тетіктерін дамыту;

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

5) тәуекелдерді басқару бөлімшесін қоса алғанда, орталық депозитарийдің жеке бөлімшелерін тәуекелдерді сәйкестендіру және бағалау процесіне тарту, сондай-ақ орталық депозитарий қызметкерлерінің тәуекелдерді басқару саласындағы жауапкершілігін арттыру.

8. Тәуекелдер мынадай сипаттамалар:

- 1) тәуекелдер басталуының жиілігі;
- 2) тәуекелдер ықпалының ауқымы бойынша талданады.

9. Тәуекел талдау нәтижелері негізінде жол берілген ретінде айқындалған тәуекелдер көрсеткішінің мәніне қатысты қабылданатын және қабылданбайтын тәуекелдер ретінде реттеледі.

10. Тәуекелдерді басқару бөлімшесі басқармаға есепке алу жүйесін және тізілімдерді жүргізу, басқа номиналды ұстаушылар үшін номиналды ұстау процестерінің, қаржы құралдарындағы есеп айырысулардың және осындай техникалық іркілістер мен өзге жағдайлар туындаған күні есепке алу жүйесіндегі және тізілімдердегі мәліметтерді көрсету процестерінің бұзылуына әкелген техникалық іркілістер мен жағдайлар туралы мәліметтер ұсынады.

11. Орталық депозитарийдің басқармасы осы қосымшаның 10-тармағында көрсетілген техникалық іркілістер мен жағдайлар туралы мәліметтерді осы жағдай басталған күннен кейінгі күн ішінде директорлар кеңесі мен уәкілетті органға беруді қамтамасыз етеді.

12. Тәуекелдерді басқару бөлімшесі жартыжылдық негізде орталық депозитарийдің директорлар кеңесі мен басқармасына Қағидаларға 2-қосымшаға сәйкес нысан бойынша Тәуекелдерді басқару жөніндегі қызмет туралы ақпарат береді.

13. Орталық депозитарийдің басқармасы орталық депозитарийдің директорлар кеңесі бекітетін тәуекелдер көрсеткіштерінің рұқсат етілген ең жоғары мәндерін айқындайды.

14. Жаңа тәуекелдер туындаған жағдайда және (немесе) тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері тәуекелді сәйкестендірген және (немесе) осы сәйкессіздікті анықтаған бөлімшенің тәуекелдер көрсеткіштерінің рұқсат етілген ең жоғары мәндеріне сәйкес келмеген жағдайда, орталық депозитарийдің директорлар кеңесін және басқармасын хабардар етеді.

15. Басқарма тәуекелдерді бағалау нәтижелерінің негізінде оларды барынша азайтуға бағытталған ықтимал шараларды айқындайды.

16. Тәуекелдерді барынша азайту тәуекелдердің мәні тәуекелдер көрсеткіштерінің рұқсат етілген мәндерінің шегіне жақындаған не шегінен асқан жағдайларда қажет болады. Тәуекелдерді барынша азайту мына іс-шаралар арқылы жүзеге асырылады, бірақ олармен шектелмейді:

- 1) ішкі бақылау жүйесін енгізу, тәуекелдерге мұқият мониторингтеуді және қадағалауды жүзеге асыру, тәуекелдерді басқару саласында қызметкерлердің біліктілігін арттыру;

- 2) орталық депозитарийдің қызметі процесінде орталық депозитарийдің органдары қабылдайтын осындай немесе өзге шешімдерге тән тәуекелдер туындаған жағдайда, сәйкестендіру және зиянды барынша азайту мүмкіндігі бойынша рәсімдерді жетілдіру;

3) ішкі аудит қызметінің орталық депозитарийдің жұмыс істеуін және (немесе) оның бөлімшелерінің жұмысын жоспардан тыс тексерулерді жүргізуі;

4) орталық депозитарийдің есепке алу жүйесінің және тізілімдерінің, өзге ақпараттық және коммуникациялық жүйелерінің аудитін 2 (екі) жылда кемінде 1 (бір) рет жүргізу;

5) орталық депозитарий басшы қызметкерлерінің тарапынан тәуекелдерді барынша азайтуға бағытталған іс-шараларға бақылауды арттыру;

6) орталық депозитарийдің ішкі құжаттарында көзделген жағдайларда қосымша арнайы (кепілдік және (немесе) резервтік) қорларды қалыптастыру.

17. Орталық депозитарийдің директорлар кеңесі тәуекелдер басталуының болған жағдайлары бойынша есептілікті беру тәртібін бекітеді, оның міндеті:

1) тәуекелдердің басталуы салдарынан болған келтірілген зиян және теріс оқиғалар туралы ақпараттық базаны қалыптастыру;

2) тәуекелдердің басталуы нәтижесінде келтірілген нақты зиян туралы ақпаратты талдау арқылы операциялық тәуекелдерді басқару және барынша азайту жөніндегі процестерді жетілдіру;

3) тәуекелдердің басталуы нәтижесінде туындаған зиянның құнына кезеңдік бағалауды жүргізу;

4) тәуекелдер басталуының елеулі жағдайларына уақтылы және тиісінше ден қоюды камтамасыз ету;

5) деректерді жинау және енгізу, сондай-ақ ақпаратты қайталау және (немесе) жіберіп алу бойынша қателерді болдырмау жөніндегі рәсімдерді толық үйлестіруді камтамасыз ету болып табылады.

Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығы
субъектілерінің қызметін реттеу
мәселелері бойынша өзгерістер
енгізілетін нормативтік
құқықтық актілерінің
тізбесіне 4-қосымша
Орталық депозитарийге
арналған тәуекелдерді басқару
және ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру қағидаларына
5-қосымша

Тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесінің ішкі құжаттарына қойылатын талаптар

1. Орталық депозитарийдің тәуекелдерді басқару жүйесі мына ішкі құжаттардың болуын көздейді, бірақ олармен шектелмейді:

1) орталық депозитарийдің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясаты;

2) орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау тәртібі;

3) ішкі бақылау мен ішкі аудитті жүзеге асыру рәсімдері;

4) қылмыстық жолмен алынған кірістерді заңдастыруға (жылыстауға) және терроризмді қаржыландыруға қарсы іс қимылға бағытталған рәсімдерді;

5) орталық депозитарийде орын алған және әлеуетті мүдде қайшылықтарын басқару рәсімі;

6) орталық депозитарийдің, оның қызметкерлерінің және үшінші тұлғалардың өз мүдделері үшін оларды пайдалануларын болдырмауға бағытталған коммерциялық және (немесе) Қазақстан Республикасының заңдарымен қорғалатын мәліметтерді (бұдан әрі – конфиденциалды ақпарат) сақтауды қамтамасыз ету рәсімдері;

7) қаржылық құралдарымен мәмілелер бойынша клирингті жүзеге асыру рәсімдері;

8) эмитенттер мен бағалы қағаздарды ұстаушылардың бағалы қағаздарды шығару, орналастыру және айналысы жөніндегі олардың қызметінің тәртібін регламенттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасының талаптарына және орталық депозитарийдің ішкі құжаттарына сәйкестігі тұрғысынан мониторинг жүргізу және бақылау рәсімдері;

9) орталық депозитарийдің ақпараттық саясаты;

10) қауіпсіздік техникасы бойынша нұсқаулық;

11) ақпараттық жүйелердің қауіпсіздігін қамтамасыз ету жөніндегі нұсқаулық;

12) клиенттердің, эмитенттердің және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушылардың бұйрықтарын уақтылы орындамауды және (немесе) орындамауды, сондай-ақ деректерді орталық депозитарийдің есепке алу жүйесіне, бағалы қағаздардың ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған нарықтарында жасалған туынды қаржы құралдарымен мәмілелердің тізілімі жүйесіне қате енгізуді болдырмауға бағытталған рәсімдер;

13) орталық депозитарийдің операциялық процестерін қолданыстағы бақылаудың тиімділігін оңтайландыру бойынша рәсімдер;

14) орталық депозитарийдің қызметін жүзеге асыру процесінде ақпаратты жасау және жария ету рәсімдері;

15) резервтік техникалық орталыққа қойылатын талаптар;

16) бағалы қағаздарды ұстаушылар тізілімдерінің жүйесін құрайтын орталық депозитарийдің архивтік құжаттарын сақтауға арналған үй-жайға қойылатын талаптар;

17) басқарушылық ақпарат жүйесінің жұмыс істеу тәртібі;

18) орталық депозитарийдің директорлар кеңесі белгілеген өзге құжаттар.

2. Орталық депозитарийдің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясаты мыналарды:

1) тәуекелдерді басқару саласында директорлар кеңесінің, басқарманың, тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшенің және басқа бөлімшелердің өкілеттері мен функционалдық міндеттерін, сондай-ақ көрсетілген бөлімшелер арасында ақпаратпен алмасу тәртібін;

2) орталық депозитарийдің қызметімен және оның есепке алу және тізілім жүйесінің жұмыс істеуіне байланысты тәуекелдер көрсеткіштерінің сандық мәндерін

анықтау тәртібін қоса алғанда, тәуекелдерді сәйкестендіру мен бағалау бойынша рәсімдерді, сондай-ақ ішкі құжаттарға сәйкес тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндерін анықтау бойынша рәсімдерді;

3) орталық депозитарий қызметінің және оның есепке алу және тізілім жүйелерінің жұмысы процесінде туындайтын тәуекелдерді басқару жөніндегі шараларды;

4) стресс-тестинг әдіснамасын қоса алғанда, тәуекелдердің әрбір түрлері бойынша стресс-тестингті жүзеге асыру тәртібін;

5) осы тармақтың 2) тармақшасында белгіленген рәсімдердің тиімділігі мониторингінің, тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері және тәуекелдерді басқару жөніндегі шараларды бағалаудың барабарлығы тетігін;

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

7) сәйкестендірілген (анықталған) тәуекелдердің мониторингін, оларды бағалау және бақылау бойынша рәсімдерді, оның ішінде:

тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшенің орталық депозитарийдің басқа бөлімшелерімен бірлесе отырып тәуекелдердің мониторингі мен идентификаттау бойынша қабылдайтын шараларды;

тәуекелдердің туындау жиілігін бағалауды, осы тәуекелдер әсер еткен ықпалды әрі қарай бөлуді және тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндерін белгіліп еуді қоса алғанда, тәуекелдерді басқару бөлімшесі жүзеге асыратын тәуекелдерді бағалауды;

тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері және тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндері өзгеруінің мониторингін қамтитын, тәуекелдерді басқару бөлімшесі жүргізетін тәуекелдердің, сондай-ақ тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндеріне сәйкес келмеген жағдайда, тәуекелдерді барынша төмендету мақсатында қолданылатын шаралардың мониторингін;

тәуекелдерді басқару бөлімшесінің орталық депозитарийдің беделіне зиян келтіретін және (немесе) құқықтық тәуекеліне ықпал ететін кез келген маңызды жағдайлар туралы есептілікті директорлар кеңесіне дереу ұсыну тетігін айқындайды.

3. Орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау тәртібі меншікті активтер есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асырудың талаптары мен тәртібін, меншікті активтер есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру процесінде қолданылатын құжаттардың үлгі нысандарын белгілейді және мыналар:

1) орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау саясатын әзірлеу;

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

ұсынымдар беруге уәкілетті тұлғалар лауазымдарының тізбесін;

инвестициялық портфельдің жай-күйін талдау тәртібін;

инвестициялауды жүзеге асыру болжанатын қаржы құралдарының болуын, айналымы мен кірістілігінің талаптарын талдау тәртібін;

инвестициялауды жүзеге асыру болжанатын қаржы құралдарымен байланысты тәуекелдерді талдау тәртібін;

ұсынымдар беру үшін маңызды факторлардың талдауын жүзеге асыру тәртібін;

3) инвестициялаудың мынадай лимиттерін айқындау:

қаржы құралдарының түрлері бойынша;

қызметінің негізгі түрі экономиканың белгілі бір секторымен байланысты эмитенттің қаржы құралдарына инвестициялау лимиттері;

қаржы құралдары үшін "stop-loss" лимиттері;

қаржы құралдары үшін "take-profit" лимиттері;

4) инвестициялық комитет жұмысының сипаттамасын, отырыстар өткізу мен нәтижелерін ресімдеу кезеңділігін қамтитын орталық депозитарийдің меншікті активтеріне қатысты инвестициялық шешімдер қабылдау;

5) инвестициялық шешімдерді дайындау, қабылдау және орындау процесінде орталық депозитарийдің органдары мен бөлімшелерінің өзара іс-қимылдары;

6) делдалмен (брокермен) өзара іс-қимыл жасау (ол болған кезде), мәмілелер жасауды бақылау, активтердің құрамы мен қозғалысын салыстырып тексеруді жүзеге асыру, жасалған мәмілелердің ішкі есебін және құжат айналымын жүргізу жөніндегі процестердің сипаттамасын, сондай-ақ орталық депозитарийдің меншікті активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасауды бақылауды жүзеге асыратын лауазымды адамдардың тізбесін қамтитын өз активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу және олардың орындалуын бақылауды жүзеге асыру;

7) орталық депозитарий Басқармасының уәкілетті орган алдында меншікті активтер есебінен жасалған қаржы құралдарымен операциялар бойынша қызметтің нәтижелері туралы есептілікті дайындауы бойынша рәсімдердің сипаттамасын қамтиды.

Орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау тәртібі сондай-ақ, орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымның басқаруына берген жағдайда, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі тиісті шартта осы тармақтың 3) тармақшасында көрсетілген орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау лимиттері көзделетіні жөніндегі талапты белгілейді.

4. Меншікті активтерді инвестициялау саясаты мыналарды:

1) меншікті активтерді инвестициялаудың мақсаттары мен стратегиясын;

2) инвестициялау объектілерінің сипаттамасы мен тізбесін;

3) қаржы құралдарының түрлері бойынша меншікті активтерді инвестициялау лимиттерін;

4) меншікті активтер есебінен жасалатын қаржы құралдарымен мәмілелерге қатысты белгіленген талаптар мен шектеулер;

5) хеджирлеу құралдарының тізбесін және сипаттамасын көрсете отырып, меншікті активтерді хеджирлеу және әртараптандыру талаптары;

6) меншікті активтерді инвестициялаумен байланысты тәуекелдерді айқындайды.

5. Орталық депозитарийдің директорлар кеңесі орталық депозитарийдің меншікті активтерін инвестициялау саясатын және оған енгізілетін барлық өзгерістер мен толықтыруларды бекітеді.

6. Орталық депозитарийдің директорлар кеңесі ішкі бақылаудың барабар жүйесінің болуын, ішкі аудит қызметін құруды қамтамасыз етеді және орталық депозитарийдің қызметкерлері ішкі бақылау саласында өз міндеттерін, ішкі аудит қызметі ішкі аудит саласындағы өз міндеттерін орындау үшін жағдайлар жасайды.

7. Ішкі бақылау мен ішкі аудитті жүзеге асыру рәсімдерінде:

1) ішкі аудит қызметінің құрамы, оның функциялары, міндеттері мен өкілеттіктері;

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

3) ішкі аудит пен ішкі бақылаудың мәні мен объектісі;

4) ішкі аудит қызметінің тексерулер жүргізу ауқымы мен жиілігі;

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

6) ішкі аудитті жүргізу жоспарын жасауға қойылатын талаптар;

7) ішкі аудит қызметінің тексеру нәтижелері туралы есептерді орталық депозитарийдің директорлар кеңесіне ұсыну мерзімдері мен нысаны айқындалады.

8. Қылмыстық жолмен алынған кірістерді заңдастыруға (жылыстатуға) және терроризмді қаржыландыруға қарсы іс-қимылдарға бағытталған рәсімдерде:

1) "Қылмыстық жолмен алынған кірістерді заңдастыруға (жылыстатуға) және терроризмді қаржыландыруға қарсы іс-қимыл туралы" Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі - Кірістерді жылыстатуға қарсы іс-қимыл туралы заң) сәйкес клиенттерді сәйкестендіру және олардың операцияларын мониторингтеу тәртібі;

2) Кірістерді жылыстатуға қарсы іс-қимыл туралы заңға сәйкес қаржылық мониторингті жүзеге асыратын және қылмыстық жолмен алынған кірістерді заңдастыруға (жылыстатуға) және терроризмді қаржыландыруға қарсы іс-қимыл бойынша өзге шараларды қабылдайтын мемлекеттік органға қаржылық мониторингке жататын операциялар туралы, оның ішінде күдікті операциялар туралы мәліметтер мен ақпаратты беру айқындалады.

9. Орталық депозитарий қызметін жүзеге асыру барысында оның органдары мен (немесе) бөлімшелері арасында туындайтын орталық депозитарийде орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын басқару рәсімдері мыналарды айқындайды:

1) мыналарды қамтамасыз етуге бағытталған орталық депозитарий органдарының шешімдерді қабылдау тәртібін:

орталық депозитарий органдарының мүшелері қабылдайтын шешімдердің тәуелсіздігін;

орталық депозитарий органдары мүшелерінің қабылдайтын шешімдерге мүдделі болмауын;

орталық депозитарийдің органдары мүшелерінің және қызметкерлерінің орталық депозитарийдің органдарының отырыстарын өткізу барысында алынған ақпаратты барша адамға арасында осы ақпаратты ресми жария еткенге дейін оны өзінің жеке мақсатында не үшінші тұлғалардың мүддесіне қолдануларын шектеулерді;

2) орталық депозитарий органдарының отырыстарын өткізу қорытындысы бойынша хаттамаларды міндетті жасау мен сақтау бойынша талаптарды;

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

4) орын алған мүдделер қақтығысын реттеу, сондай-ақ мүдделер қақтығысын реттеуге бағытталған алдын алу шараларын қабылдау мақсатында іс-шаралар жүргізу тәртібі.

10. Орталық депозитарийдің қызметін жүзеге асыру барысында органдар мен (немесе) бөлімшелер арасында туындайтын орын алған және әлеуетті мүдделер қайшылығын басқару мақсатында орталық депозитарий мынадай шаралар қабылдайды:

1) мүдделер қайшылығы бар немесе туындауы мүмкін бөлімшелердің орталық депозитарийдің түрлі басшы қызметкерлеріне есеп беруі қамтамасыз етіледі;

2) орын алған және әлеуетті мүдделер қайшылығын ескере отырып орталық депозитарийдің бөлімшелері мен органдары арасында ақпаратпен алмасу тәртібі әзірленуде және енгізілуде;

3) орталық депозитарийдің директорлар кеңесі бекіткен жұмыс жоспарына сәйкес ішкі аудит қызметі орталық депозитарийдің бөлімшелерінің қызметін және қызметкерлердің орталық депозитарий қабылдаған орталық депозитарийде орын алған және әлеуетті мүдделер қайшылығын басқару рәсімдеріне сәйкестігін үнемі тексереді.

11. Конфиденциалды ақпаратты құрайтын мәліметтерді орталық депозитарийдің, оның қызметкерлерінің немесе үшінші тұлғалардың жеке мүдделері үшін пайдаланудың алдын алуға бағытталған олардың сақталуын қамтамасыз ету рәсімдеріне мына шаралар кіреді:

1) инсайдерлермен, сондай-ақ олармен үлестес тұлғаларымен өз мүддесі немесе үшінші тұлғалардың мүдделері үшін инсайдерлік ақпаратты қолдана отырып бағалы қағаздармен мәмілелер жасаудың алдын алу;

2) инсайдерлік немесе соған негізделген ақпаратты инсайдерлердің, сондай-ақ олардың үлестес тұлғаларының үшінші тұлғаларға ашуының алдын алу;

3) инсайдерлік ақпаратты немесе инсайдерлік ақпаратқа негізделген ақпаратты, оның ішінде инсайдерлердің, сондай-ақ олардың үлестес тұлғаларының бағалы қағаздармен мәмілелер жасау бойынша ұсыныстарында пайдалануын алдын алу;

4) Қазақстан Республикасының Бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасында көзделген жағдайларды қоспағанда, конфиденциалды немесе соған негізделген ақпаратты үшінші тұлғаларға берудің немесе барша адамға таратудың алдын алу;

5) орталық депозитарий қызметкерлерінің үшінші тұлғаларға инсайдерлік және өзге де конфиденциалды ақпаратқа негізделген қаржы құралдарымен мәмілелер жасау туралы үшінші тұлғаларға ұсыныстар беру мүмкіндігін шектеу;

6) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар нарығы туралы заң) 56-1-бабында көзделген шараларды орталық депозитарийдің инсайдерлік ақпараттық басқаруды және пайдалануды бақылау бөлігінде жүзеге асыру.

12. Қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингті жүзеге асыру рәсімдері мыналарды айқындайды:

1) есеп айырысуларды жинау, салыстырып тексеру және растау бөлігінде қателер туындауының алдын алуға, сондай-ақ оларды өзара есепке алуды жүргізуге бағытталған іс-шаралар;

2) егер клиринг операцияларын автоматты түрде жүзеге асырған немесе орталық депозитарийде клиринг операцияларын автоматты түрде жүзеге асыру көзделмеген жағдайда клиринг операцияларының дұрыс жүзеге асырылуын және клиринг операцияларын жүзеге асыруға тікелей жауап беретін қызметкерлердің біліктілігін тұрақты түрде арттыруды басқарма тарапынан бақылауды қамтамасыз еткен жағдайда орталық депозитарийдің бағдарламалық-техникалық қамтамасыз етуіне есеп айырысуды жүргізу жүйесінде қателер және техникалық іркілістердің болуын мониторингтеу және тестілеу тәртібі;

3) клиринг операцияларын жүзеге асыру процесінде қателіктер туындаған кезде депоненттер мен орталық депозитарий арасындағы мәселелерді шешу тәртібі.

13. Эмитенттердің және бағалы қағаздарды ұстаушылардың бағалы қағаздарды шығару, орналастыру және айналысқа шығару бойынша тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының Бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық депозитарийдің ішкі құжаттарының талаптарына сәйкес келу мәнін мониторингтеу мен бақылау рәсімдері мыналарды айқындайды:

1) эмитенттердің және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушылардың ұсынатын бұйрықтарын Бағалы қағаздар нарығы туралы заңның 80-бабының 5-тармағына сәйкес уәкілетті органның бағалы қағаздарды ұстаушылардың тізілімін жүргізу бойынша қызметті жүзеге асыру тәртібін айқындайтын нормативтік құқықтық актісінде белгіленген жағдайларда оларды орындаудан бас тарту үшін негіздемелердің болуына тексеру жүргізу тәртібі;

2) бағалы қағаздардың қайталама нарығында айналыста тұрған бағалы қағаздардың саны уәкілетті орган тіркеген бағалы қағаздардың санына сәйкес келуін бақылауды жүзеге асыру тәртібі.

14. Орталық депозитарийдің ақпараттық саясаты мыналарды айқындайды:

1) орталық депозитарийдің қор биржасымен, эмитенттермен, бағалы қағаздарды ұстаушылармен, депоненттермен, депоненттердің клиенттерімен, сондай-ақ бұқаралық ақпарат құралдарымен ақпараттық өзара қарым-қатынас жасау тәртібі;

2) орталық депозитарийдің беделіне әсер етуі ықтимал ақпаратқа тұрақты мониторинг бойынша талаптар;

3) орталық депозитарийдің беделіне зиян әкелетін ақпарат пайда болған және таратылған жағдайда қажетті шараларды уақтылы қабылдау бойынша талаптар.

15. Қауіпсіздік техникасы жөніндегі нұсқаулықта мыналар айқындалады:

1) өрт қауіпсіздігі бойынша талаптар;

2) форс-мажорлық және (немесе) күтпеген жағдайлар туындаса орталық депозитарий қызметкерлерінің іс-әрекеттерінің сипаты бар, төтенше және (немесе) күтпеген жағдайлар туындау жағдайындағы іс-әрекеттер жоспары;

3) орталық депозитарий қызметкерлерінің бағдарламалық-техникалық кешендерін және өзге жабдықты пайдалану тәртібі;

4) орталық депозитарийдің үй-жайлары жабылу алдында қараудың жүйелілігі.

16. Ақпараттық жүйелердің қауіпсіздігін қамтамасыз ету жөніндегі нұсқаулықта айқындалады:

1) ақпараттық жүйелердің қауіпсіздігін қамтамасыз ету бойынша талаптар;

2) ақпараттық қауіпсіздікті қамтамасыз етудің ұйымдастыру шаралары;

3) ақпараттық қауіпсіздікті қамтамасыз етудің бағдарламалық-техникалық шаралары;

4) ақпарат жинақтауға бөлінген ресурстарға (дискі кеңістігі, директория, желілік ресурстар, деректер базасы және басқалары) рұқсат алу, орталық депозитарийдің есепке алу жүйесінен ақпаратты алу тәртібі және көлемі, ақпаратты сақтау, архивтеу не басқаша өңдеу;

5) орталық депозитарийдің есепке алу жүйесін құрайтын, оның ішінде резервтік техникалық орталықта тұрған электрондық деректердің сақталуына бағытталған шаралар;

6) жазбаны оқитын құрылғыларға және компакт дискілерге құрылғыны ажырату немесе алып қою арқылы қол жеткізуге тыйым салу;

7) орталық депозитарийдің ақпараттық жүйелеріне қызметкерлердің рұқсат алу деңгейлерін анықтау тәртібі;

8) серверлік бөлмелерге осы бөлмелерге рұқсаты бар орталық депозитарийдің түрлі қызметкерлердегі екі кілтті пайдалану арқылы рұқсат алу тәртібі.

17. клиенттердің, эмитенттердің және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушылардың бұйрықтарын уақтылы орындамауды және (немесе) орындамауды, сондай-ақ деректерді орталық депозитарийдің есепке алу жүйесіне қате енгізуді болдырмауға бағытталған рәсімдер мыналарды айқындайды:

1) орталық депозитарийдің депоненттерінің, эмитенттерінің және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушыларының бұйрықтарын уақтылы орындамауды және (немесе) орындамауды болдырмауға бағытталған шаралар;

2) есепке алу және тізілімдер жүйелеріне деректер, оның ішінде түрлі қызметкерлердің бір бұйрықтың деректерін екі рет енгізу арқылы қате енгізудің алдын алу шаралары;

3) орталық депозитарийдің ақпараттық жүйелерін пайдаланушыларға орталық депозитарийдің есепке алу жүйесіндегі мәліметтерді өзгерту өкілеттігіне ие пайдаланушылар үшін орталық депозитарийдің есепке алу жүйесіне кіру парольдерін орнату құқықтарын беру тәртібі;

4) бұйрықтарды және олардың орындалуын, сондай-ақ клиенттердің, эмитенттердің және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушылардың шағымдарын және оларды қанағаттандыру бойынша шараларды есепке алу электрондық журналының нысаны;

5) өңделген бұйрықтарды бастапқы құжаттармен салыстырып тексеру тәртібі;

6) операцияларды жасауға берілген бұйрықтың мәртебесі туралы клиенттерді, эмитенттерді және (немесе) бағалы қағаздарды ұстаушыларды хабардар ету тәртібі.

18. Орталық депозитарийдің операциялық процестерін қолданыстағы бақылаудың тиімділігін оңтайландыру рәсімдері мыналарды айқындайды:

1) бастапқы құжаттар негізінде іс-әрекеттерді жүзеге асырумен байланысты тәуекелдер:

бастапқы құжаттарды уәкілетті емес тұлғаның ұсынуы;

бастапқы құжаттардың ұрлануы, айырбасталуы немесе жоғалуы;

қолданыста жоқ бұйрықты ақпараттық жүйеге, есепке алу және тізілімдер жүйелеріне енгізу;

бір бұйрықтың деректерін түрлі қызметкерлердің ақпараттық жүйеге, есепке алу және тізілімдер жүйелеріне екі рет енгізуі;

бұйрық деректерінің ақпараттық жүйеге, есепке алу және тізілімдер жүйелеріне дұрыс енгізілмеуі;

бұйрықты ақпараттық жүйеге, есепке алу және тізілімдер жүйелеріне енгізуді орындамау;

бұйрықты ақпараттық жүйеге, есепке алу және тізілімдер жүйелеріне уақтылы енгізбеу;

бұйрықтың ақпараттық жүйедегі, орталық депозитарийдің есепке алу жүйесіндегі дұрыс емес мәртебесін таңдау;

бұйрықтың ақпараттық жүйедегі, есепке алу және тізілімдер жүйелеріндегі мәртебесіне өзгеріс енгізбеу;

бұйрықтың ақпараттық жүйеде, есепке алу және тізілімдер жүйелеріндегі өзгертуге жатпайтын мәртебесін өзгерту;

ақпараттық жүйедегі, есепке алу және тізілімдер жүйелеріндегі өзгертуге жатпайтын анықтамалықтар деректерін өзгерту;

ақпараттық жүйеде, есепке алу және тізілімдер жүйелеріндегі анықтамалықтар деректерінің дұрыс өзгертілмеуі;

ақпараттық жүйедегі, есепке алу және тізілімдер жүйелеріндегі анықтамалықтар деректеріне өзгерістер енгізбеу;

тиісті құжатсыз ақпараттық жүйеде, есепке алу және тізілімдер жүйелерінде анықтамалықтар деректерін өзгерту;

ақпараттық жүйеде, есепке алу және тізілімдер жүйелерінде анықтамалықтар деректерін уақтылы өзгертпеу;

2) бастапқы құжаттар негізінде есептік және өзге құжаттарды берумен байланысты тәуекелдер:

есептік құжатты қалыптастыруды орындамау;

есептік құжатты уақтылы қалыптастырмау;

есептік құжаттағы дұрыс емес деректер;

бұйрықтың қате мәртебесін көрсете отырып орындау туралы есепті қалыптастыру;

есептік құжатты уәкілетті емес тұлғаға беру;

есептік құжаттарды ұрлау, айырбастау және жоғалту;

3) ақпараттық жүйелерді пайдалануға байланысты тәуекелдер;

операциялық күнді ашу (жабу) рәсімдерін орындамау;

қор биржасының терминалын қосуды орындамау;

кіріс файлының дұрыс емес форматы;

кіріс файлының дұрыс емес мазмұны;

түрлі қызметкерлердің дерекқорда жазбаны қалыптастыру үшін деректерді екі рет енгізуі;

дерекқорда жазбаны қалыптастыруды орындамау;

дерекқорда жазбаны дұрыс емес қалыптастыру;

ақпараттық жүйеде жөнелтушіден келген құжаттардың қайталануы (операциялық күн ішінде);

есептеулерді кейінге қалдыру күнімен бұйрықты кезекке қою;

ақпараттық жүйеде транзакцияларды жүргізу кезіндегі қателер;

бұйрықты қарсы бұйрықсыз орындау (екі қарсы бұйрықтар негізінде тіркелетін мәмілелер бойынша);

айналыста болмаған бағалы қағаздар бойынша бұйрықты орындау;

регламентке кірмейтін уақытта бұйрықты орындау;

регламентке кірмейтін уақытта бұйрықты қабылдау;
ашылмаған операциялық күн кезінде бұйрықты орындау;
бағалы қағаздармен операцияларды тоқтата тұру кезінде бұйрықты орындау;
рұқсат етілмеген операциялар бойынша бұйрықты орындау;
4) ақпараттық жүйелерді пайдалануға байланысты тәуекелдер:
компьютерлік вирустардың енуі;
лицензиялық емес бағдарламаларды пайдалану;
ақпараттық жүйелерге рұқсатсыз кіру;
серверлік жабдыққа техникалық қызмет көрсету кезіндегі қателер;
электрлік қоректендіру жүйесіндегі іркілістер;
серверлерді кондиционирлеу жүйелерінің іркілістері;
серверлік жабдықтың техникалық іркілісі
желілік жабдықтың техникалық іркілісі;
деректерді тасымалдағыштарды (қатты дискілерді және өзге тасымалдағыштарды)
ұрлау, әдейі бүлдіру;
деректерді тасымалдағыштарға (қатты дискілердегі және өзге тасымалдағыштар)
рұқсатсыз қол жеткізу;
табиғи сипаттағы төтенше жағдай;
серверлік бөлмедегі өрт;
серверлік бөлмені судың басып қалуы;
ақпараттық жүйедегі бағдарламалық іркіліс;
тапсырыс берушінің бағдарламалық қамтамасыз етуді әзірлеу бойынша қалыпқа
келтірілген талаптарының болмауы;
бағдарламалық қамтамасыз етудің кодын белгілеушілер үшін техникалық
тапсырманы дұрыс жасамау;
бағдарламалық қамтамасыз ету кодын жазу кезіндегі қате;
әзірленген бағдарламалық қамтамасыз етуді енгізу кезіндегі қате.

19. Орталық депозитарийдің қызметін жүзеге асыру барысында жасау және ақпаратты жариялау рәсімі мыналарды:

1) бағалы қағаздарды ұстаушыларға эмитент акционерлерінің жалпы жиналысын өткізу немесе эмитенттің эмиссиялық бағалы қағаздар бойынша кірісті төлеуі туралы, сондай-ақ эмитенттің бағалы қағаздарының шығарылымы туралы ақпаратты Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасында белгіленген жағдайларда жасау және жариялау тәртібін;

2) депоненттердің, депоненттер клиенттерінің, эмитенттердің және өзге де жеке және заңды тұлғалардың сұратулары негізінде оларға есепке алу және тізілімдер жүйесін құрайтын ақпаратты ұсыну рәсімін;

3) Бағалы қағаздар нарығы туралы заңның 43-бабына сәйкес орталық депозитарийді есепке алу жүйесін және жауапкершілігі шектеулі серіктестік қатысушыларының

тізілімдері жүйесін құрайтын мәліметтерді алу құқығына ие мемлекеттік органдарға ақпарат ұсыну рәсімін айқындайды.

20. Орталық депозитарийдің резервтік техникалық орталығы бар және жедел іске қосу үшін оның тұрақты дайындығын қамтамасыз етеді. Резервтік техникалық орталық мынадай талаптарға сәйкес келеді:

1) есепке алу және тізілімдер жүйесін құрайтын, есепке алудың және тізілімдердің негізгі жүйелеріне ұқсас электрондық деректердің көшірмесі бар;

2) орталық депозитарийдің негізгі жүйелерінің орналасқан орны бойынша тұрған резервтік жүйелерге ұқсас резервтік жүйелердің өзекті көшірмесі бар;

3) барлық дереккөздер мен ақпараттық жүйелердің өзекті көшірмелерін қамтиды, олардың жұмысындағы іркілістер негізгі қызметтің тоқтауына және клиенттерге қызмет көрсетудің мүмкін болмауына әкеп соғады;

4) техникалық резервтік орталықтың қауіпсіздігі мен үзіліссіз жұмысына әсер ететін техногендік және табиғи сипаттарды ескере отырып орталық депозитарийдің негізгі жүйелерінің орналасқан жерінен қауіпсіз арақашықтықта орналасады;

5) орталық депозитарийдің қызметін жүзеге асыру үшін қажетті барлық коммуникациялармен қамтамасыз етіледі;

6) орталық депозитарийдің есепке алу және тізілімдер жүйесінің орналасқан орны бойынша штаттан тыс жағдай туындаған кезде келесі жұмыс күнінен кешіктірмей қызметті жүзеге асыру мүмкіндігін береді.

21. Бағалы қағаздарды ұстаушылардың тізілімі жүйесін құрайтын орталық депозитарийдің архив құжаттарын сақтау үшін пайдаланылатын үй-жайлар мынадай талаптарға сәйкес келеді:

1) архив құжаттарын сақтауға бейімделген жеке үй-жай;

2) құжаттарды сақтауға арналған архив сақтау орнында құжаттарды сақтаудың талаптары мен өлшемшарттарын: сақтаудың температуралық-ылғалдылық, жарық, санитарлық-гигиеналық, күзет режимдерінің жасалуы және сақталуы қамтамасыз етіледі;

3) архив қызметкерлерінің жұмыс бөлмелері, сондай-ақ орталық депозитарий және (немесе) орталық депозитарийдің архив құжаттарын сақтау қызметін көрсететін ұйым қызметкерлерінің үй-жайлары архив сақтау орнынан оқшауланған;

4) архив сақтау орны химиялық заттарды, тағам өнімдерін сақтауға және қолдануға байланысты зертханалық, өндірістік және қойма үй-жайларынан алшақ орналасады және олармен ортақ желдеткіш арналары болмайды;

5) архив сақтау орны өрт шығу қауіпсіздігімен қамтамасыз етіледі, өрт сөндіру дабылымен жабдықталады және су баспауына кепілдік беріледі. Жалпы және әр қабаттағы ажыратқыштар архив сақтау орнынан тыс орналастырылады. Архив сақтау орнында газ, су жүргізетін, канализациялық және өзге де магистралды құбырлар орналастырылмайды;

6) архив сақтау орны күзет дабылымен жабдықталады;

7) архив сақтау орны стационарлық немесе жылжымалы металл стеллаждармен жабдықталады.

22. Басқару ақпарат жүйесінің жұмыс істеу тәртібі директорлар кеңесінің міндеттерін тиімді орындау мақсатында орталық депозитарий қызметінің барлық бағыттары бойынша толық, дәйекті және уақтылы ақпаратты директорлар кеңесіне тұрақты негізде беруін қамтамасыз етеді.

Басқарушылық ақпарат жүйесінің жұмыс істеу тәртібі ақпаратты уақтылы және толық көлемде дайындауға және орталық депозитарийдің директорлар кеңесіне беруге жауапты орталық депозитарийдің тұлғаларын, құрылымдық бөлімшелерін, органдарын көрсете отырып, орталық депозитарийдің қызметі туралы басқарушылық ақпаратты орталық депозитарийдің директорлар кеңесіне ұсыну өлшемшарттарын, құрамын, қалыптастыру жиілігін және нысандарын қамтиды.

Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығы
субъектілерінің қызметін
реттеу мәселелері бойынша
өзгерістер енгізілетін
нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
5-қосымша

Орталық депозитарийге
арналған тәуекелдерді басқару
және ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру қағидаларына
6-қосымша

Орталық депозитарийдің меншікті активтерінің есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру қызметін ұйымдастыруға қойылатын талаптар

1. Орталық депозитарийдің меншікті активтерін тиімді инвестициялауды қамтамасыз ету мақсатында тәуекелдерді басқару бөлімшесі кемінде бір тоқсанда 1 (бір) рет мыналарды жүргізеді:

1) эмитенттің қаржылық ахуалын талдауды қоса алғанда, эмитенттерді және олар шығарған (берген) қаржы құралдарына, оның активтері құнының одан әрі өсу әлеуетіне, қабылданған міндеттемелер бойынша жауап беру қабілетіне, осы эмитенттің қаржы құралдарына инвестициялауға және осы тәуекелдердің орталық депозитарийдің қаржылық жағдайына әсер етуіне байланысты тәуекелдерге талдау;

2) инвестициялау жүргізу болжанған қаржы құралдары айналымының және кірістілігінің талаптарын талдау;

3) портфельдің құрылымы, кірістіліктің өзгеру серпіні туралы мәліметтер, портфельдің құрылымын оңтайландыру жөніндегі шығынды позициялар мен

ұсынымдарды талдау қамтылатын, меншікті активтер есебінен сатып алынған бағалы қағаздар портфеліне талдау.

2. Осы қосымшаның 1-тармағында көрсетілген талдамалық зерттеулер негізінде аталған ұсынымдарды беруге негіздеме болған факторлардың толық тізбесі қамтылған ұсынымдар әзірленеді.

3. Ұсынымдар:

1) меншікті активтерді инвестициялау саясатын әзірлеу, сондай-ақ көрсетілген құжатқа өзгерістер мен толықтырулар енгізу барысында;

2) инвестициялау лимиттерін анықтау мен қайта қарау барысында;

3) орталық депозитарийдің меншікті активтері есебінен мәмілелерді жасау туралы инвестициялық шешімдерді қабылдау кезінде беріледі.

4. Ұсынымда мынадай мәліметтер:

1) ұсынымның берілген күні және нөмірі;

2) орталық депозитарийдің ұсынымды дайындаған жауапты бөлімшесі немесе қызметкері туралы мәліметтер;

3) ұсыным беру үшін пайдаланылған ақпарат көздерінің тізбесі (сипаттамасы);

4) ұсыным беру үшін пайдаланылған ақпаратты талдау нәтижелері, мына ақпаратты қоса алғанда, бірақ онымен шектелмей:

жасалатын мәміленің меншікті активтер бойынша кірістердің болжанатын өзгерісіне әсері туралы;

осы қаржы құралын сатып алумен байланысты тәуекелдер туралы;

5) инвестициялық шешімнің ұсынылатын нұсқалары;

6) қаржы құралының түрін, көлемін, бағалар диапазонын, осы құралдың кірістілік деңгейін және басқа сипаттамаларын (талаптарын) көрсететін сипаттамасы;

7) орталық депозитарийдің инвестициялау саясатына сәйкес мәміле жасауға ұсынылатын қорытындының мақсаты;

8) ұсыным берген тұлғалардың атқаратын лауазымдарын көрсете отырып, олардың қойған қолдары;

9) орталық депозитарийдің ішкі құжаттарында белгіленген өзге де ақпарат қамтылады.

5. Ұсынымдар оларды дайындауға негіздеме болған барлық құжаттармен бірге сақталады.

6. Тәуекелдерді басқару бөлімшесі:

1) қаржы құралдарымен операциялар бойынша, оның ішінде қаржы құралдары нарығында ("stop-loss" лимиттері) бағалардың күрт ауытқуымен байланысты шамадан тыс шығыстарды болдырмау жөніндегі шұғыл рәсімдерді, сондай-ақ қаржы құралдары бойынша тиісті кірістілік бағаларының шекті деңгейлерін белгілейді, ол деңгейлерге жеткеннен кейін қаржы құралының нарықтық құнының ("take-profit" лимиттері) төмендеу ықтималдығы артады. Белсенді нарық орын алған қаржы құралдары үшін,

сондай-ақ тізбесін инвестициялық комитет анықтайтын өзге де қаржы құралдары үшін "stop-loss" және "take-profit" лимиттері белгіленеді;

2) қаржы құралдары нарығының ауқымы мен серпініне және қаржы құралының өтімділігіне сәйкес лимиттерді қайта қарауға бастамашы болады;

3) меншікті активтер бойынша өтімділікті жоғалту тәуекелдеріне ұшырайтындығы туралы қорытынды дайындайды және осы қорытындыны директорлар кеңесіне береді;

4) меншікті активтер есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру барысында алынатын ақпарат негізінде инвестициялық портфельдің кредиттік, пайыздық, валюталық және баға тәуекелдеріне ұшырағыштығы туралы қорытынды дайындайды және осы қорытындыны инвестициялық комитетке ұсынады;

5) тәуекелді бағалау моделі және ағымдағы бағаларды нарықтық бағаларға келтіру негізінде қаржы құралдарының құнын бағалауды жүргізеді, оның ішінде орталық депозитарийдің ішкі құжаттарында белгіленген нысан бойынша баға тәуекелі бойынша стресс-тестингті жүзеге асырады;

6) бэк-тестинг жүргізеді, атап айтқанда орталық депозитарий жөніндегі тарихи деректерді пайдалана отырып және стресс-тестинг жүргізу нәтижесінде есептелген нәтижелерді қаржы құралдарымен операциялар жасасудың ағымдағы (нақты) нәтижелерімен салыстырып, тәуекелдерді өлшеу рәсімдерінің тиімділігін тексеруді жүзеге асырады;

7) стресс-тестингтің және бэк-тестингтің нәтижелерін директорлар кеңесіне және тәуекелдерді бағалау мен жүйелі түрдегі стресс-тестингтердің нәтижелерін қаржы құралдарымен мәмілелер жасауға қатысты инвестициялық шешімдерді қабылдау кезінде пайдаланатын инвестициялық комитетке береді.

7. Тәуекелдерді басқару бөлімшесінің осы қосымшаның 6-тармағының 4) тармақшасына сәйкес дайындаған қорытындысында мыналармен шектелмей, төмендегі :

1) инвестициялық комитет белгілеген лимиттердің сақталуына жасалатын мәміленің әсері туралы;

2) осы қаржы құралын сатып алумен байланысты тәуекелдер туралы мәліметтер қамтылады.

8. Ұсынымдар мен қорытындылар негізінде директорлар кеңесі инвестициялаудың басым бағыттарын айқындайды, ал инвестициялық комитет инвестициялық шешімдерді қабылдайды, бір жылда кем дегенде 1 (бір) рет мынадай инвестициялау лимиттерін:

1) қаржы құралдарының түрлері бойынша инвестициялау лимиттерін;

2) негізгі қызмет түрі экономиканың белгілі бір секторымен байланысты эмитенттердің қаржы құралдарына инвестициялау лимиттерін;

3) қаржы құралдарына арналған "stop-loss" лимиттерін;

4) қаржы құралдарына арналған "take-profit" лимиттерін белгілейді және қайта қарайды.

9. Инвестициялық комитет отырысын өткізу қорытындысы бойынша міндетті түрде мыналарды:

1) отырыста қаралатын мәселелер тізбесін;

2) инвестициялық шешімді қабылдау үшін инвестициялық комитетке ұсынылған құжаттар тізбесін;

3) қаржы құралдарының атауын, сондай-ақ олармен мәмілелер жасау талаптарын көрсете отырып, осы отырыста қабылданған инвестициялық шешімдердің параметрлерін;

4) отырыста қаралатын әрбір мәселе бойынша дауыс беру қорытындыларын;

5) инвестициялық комитет мүшелері қабылданған шешіммен келіспеген және ерекше пікірі болған жағдайда, олардың негіздемелері мен күтілетін тиімділігі бар пікірлерін көрсете отырып, хаттама жасалады.

10. Хаттамаға инвестициялық комитеттің отырысқа қатысып отырған барлық мүшелері қол қояды және ол инвестициялық комитет қабылдаған инвестициялық шешімдермен бірге сақталады.

11. Инвестициялық шешім қаржы құралдарымен жасалатын бір, сол сияқты бірнеше мәмілелерге қатысты қабылданады.

12. Инвестициялық комитет отырысының қорытындысы бойынша қабылданған қаржы құралдарымен мәміле жасау үшін инвестициялық шешімде:

1) инвестициялық шешімді қабылдау күні мен нөмірі;

2) инвестициялық шешім қабылдауға негіз болған ұсынымды беру күні және нөмірі;

3) жасалуы тиіс мәміле түрі;

4) мәміле жасалатын қаржы құралын сәйкестендіргіш;

5) жасалуы тиіс мәміленің көлемі, бағасы және сомасы (көлемінің, бағасының және сомасының ауқымы);

6) мәміле жасау мерзімдері;

7) мәміле жасау болжанып отырған нарықтың түріне сілтеме (алғашқы немесе қайталама, ұйымдастырылған немесе ұйымдастырылмаған, халықаралық нарықтар);

8) мәміле жасау болжанатын делдалдың (брокердің) (мұндай бар болса) атауы;

9) инвестициялық комитет мүшелерінің біреуінде инвестициялық шешімді қабылдауға (қабылдамауға) қатысты ерекше пікірінің болуына нұсқау;

10) инвестициялық шешімді қабылдаған адамдардың атқаратын лауазымдарын көрсете отырып қойған қолдары қамтылады.

13. Хеджирлеу құралдарымен мәміле жасау үшін инвестициялық шешім осы қосымшаның 12-тармағының 1), 2), 3), 7), 8), 9) және 10) тармақшаларында көрсетілген мәліметтермен басқа мыналарды:

1) хеджирлеу құралының түрін, оны жасасу мерзімін, көлемін, құнын (сыйлықақысын) көрсете отырып, хеджирлеу операциясының жасалуы жоспарланатын нарықты және осы құралдың басқа сипаттамаларын (талаптарын) жан-жақты сипаттауды;

2) осы хеджирлеу құралын қолданудан күтілетін нәтижелерді;

3) хеджирлеу объектісі (базистік актив) тәуекелінің түрін (пайыздық, баға, валюталық және басқа да), сондай-ақ оны бағалау әдісін көрсете отырып бағалауды;

4) қажетті деректемелері (ұлттық сәйкестендіру нөмірі (ISIN коды), саны, құны, көлемі, валютасы) көрсетілген хеджирлеу объектісін;

5) осы операцияны жасау хеджирлеу объектісі бойынша ықтимал шығындардың (алынбаған кіріс) мөлшерін төмендетуге әкеп соғатынын растайтын есеп айырысуды қамтиды.

14. Инвестициялық комитет отырысының қорытындысы бойынша қабылданған инвестициялық шешім қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу үшін орындауға беріледі.