

**Бағалы қағаздар нарығын реттеу және дамыту мәселелері бойынша Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне өзгерістер енгізу туралы**

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2023 жылғы 27 қарашадағы № 87 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2023 жылғы 1 желтоқсанда № 33710 болып тіркелді

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

1. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығын реттеу және дамыту мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі бекітілсін.

2. Бағалы қағаздар нарығы департаменті Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

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

2) осы қаулы ресми түрде жарияланғаннан кейін оны Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің ресми интернет-ресурсында орналастыруды;

3) осы қаулы мемлекеттік тіркеуден өткеннен кейін он жұмыс күнінің 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 өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі.

*Қазақстан Республикасының  
Қаржы нарығын реттеу және дамыту  
Агенттігінің Төрағасы*

*М. Абылкасымова*

**"КЕЛІСІЛГЕН"**

Қазақстан Республикасының  
Стратегиялық жоспарлау және  
реформалар жөніндегі  
Ұлттық статистика бюросы

Қазақстан Республикасының  
Қаржы нарығын реттеу  
және дамыту  
Агенттігінің Басқармасының

## **Бағалы қағаздар нарығын реттеу және дамыту мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі**

1. "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 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларында:

Бағалы қағаздар нарығын реттеу және дамыту мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне (бұдан әрі – Тізбе) 1-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі Тізбеге 2-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын.

2. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17005 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларында:

қосымша Тізбеге 3-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі Тізбеге 4-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын.

3. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды белгілеу, сондай-ақ Ерте ден қою шараларын көздейтін іс-шаралар жоспарын мақұлдау қағидаларын және Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды анықтау әдістемесін бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 29 қарашадағы № 300 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 18198 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

кіріспе және 1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

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

1. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін мынадай факторлар белгіленсін:

- 1) меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициентінің төмендеуі;
- 2) жиынтық өтімді активтер көлемінің төмендеуі;
- 3) шығынды қызмет.";

көрсетілген қаулымен бекітілген Ерте ден қою шараларын көздейтін іс-шаралар жоспарын мақұлдау қағидаларында:

1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"1. Осы Ерте ден қою шараларын көздейтін іс-шаралар жоспарын мақұлдау қағидалары (бұдан әрі – Қағидалар) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі - Заң) сәйкес әзірленді және қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті органның (бұдан әрі – уәкілетті орган) бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымның ( бұдан әрі – ұйым) қаржылық орнықтылығын арттыру жөніндегі ерте ден қою шараларын көздейтін іс-шаралар жоспарын мақұлдау тәртібін айқындайды.";

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды анықтау әдістемесі Тізбеге 5-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын.

және дамыту мәселелері  
бойынша  
өзгерістер енгізілетін  
Қазақстан Республикасы  
нормативтік құқықтық  
актілерінің тізбесіне  
1-қосымша  
Инвестициялық портфельді  
басқару жөніндегі қызметті  
жүзеге асыратын ұйымдардың  
сақтауға міндетті пруденциялық  
нормативтердің мәндерін  
есептеу  
қағидаларына қосымша

### Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі

№	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		90	

	банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша			
1.4	Қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе "Астана" халықаралық қаржы 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		100	

	Республикасының бейрезидент-банкте ріндегі ағымдағы шоттардағы ақша			
1.7	"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) 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 Асошиайшн)		100	
	Қазақстан Республикасының			

1.9	<p>екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар</p>		100	
1.10	<p>Мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар: банктердің Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard &amp; 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</p>		100	

	<p>бейрезидент-бас банктері Standard &amp; Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "А"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады</p>			
1.11	<p>Standard &amp; 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 &amp; 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</p>		90	
	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "АА"-тен төмен</p>			



1.12	емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдарындағы салымдар, Еуразия даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұлттық валютасындағы салымдар		100	
1.13	Standard & Poog's (Стандард энд Пуре) 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	
	қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын қор			

2.2	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"			

2.5	<p>секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, немесе қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "</p> <p>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</p>		90	
2.6	<p>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 "</p> <p>Баламалы" алаңдары "</p>		95	

	<p>борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар</p>			
2.7	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды 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 заңды тұлғаларының</p>		60	

	<p>мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>			
2.8	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard &amp; Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard &amp; Poog'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</p>		100	
	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard &amp; Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейінгі рейтингтік</p>			

2.9	<p>бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB-"-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</p>	85		
2.10	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "AA"-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</p>	100		
	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "</p>			

2.11	BBB-"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		100	
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 ш е т 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 ш е т 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		100	

	бірінің рейтингі (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары			
2.15	Standard & Poor's (Стандард энд Пуэр) 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 Пуэр) 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 қолхаттар – барлығы, оның ішінде:			
	Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін			



3.1	шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар	100	
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, жария сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы	80	

	<p>акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық колхаттарды қоспағанда, базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық колхаттар</p>			
3.4	<p>Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының "Астана" 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</p>		60	
	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі</p>			

3.5	бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар	100	
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 заңды 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 заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің	60	

	акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық колхаттар			
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) (Экстейндж Трэйдэд Фандс) пайлары		90	
4.3	Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Экстейндж Трэйдэд Фандс) Exchange Traded Commodities (ETC) (Экстейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Экстейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары		80	
4.4	орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып		100	

	табылатын бағалы қағаздар			
4.5	<p>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</p>		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			

5.2	<p>сыйақы бойынша ( шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек ( инвестициялық портфельді басқарушының үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін коспағанда) - инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада</p>		100	
5.3	<p>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</p>		100	
5.4	<p>инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі инвестициялық</p>		100	

	портфельді басқарушының негізгі құралдары			
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	K2-1			
10.2	K2-2			
10.3	K2-3			
10.4	K2-4			

Бағалы қағаздар нарығын реттеу және дамыту мәселелері бойынша өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне  
2-қосымша  
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**

**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 қадағалау 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:

$$K = (\Theta\text{ЖА} + \Theta\text{А} - M) / (MKMM + \text{ЗА\_ИПБ\_От}), \text{ мұнда:}$$

$\Theta\text{ЖА}$  - Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын, есептеу күніне қолда бар инвестициялық портфельді басқарушының өтімділігі жоғары активтері;

$\Theta\text{А}$  - инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын өтімді активтері;

$M$  - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

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

$\text{ЗА\_ИПБ\_От}$  - есептеу күніне инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ЗА ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 4%.

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

$$K = (\Theta\text{ЖА} + \Theta\text{А} - M) / (MKMM + \text{ИПБ\_От}), \text{ мұнда:}$$

$\Theta\text{ЖА}$  - Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын, есептеу күніне қолда бар инвестициялық портфельді басқарушының өтімділігі жоғары активтері;

$\Theta\text{А}$  - 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 Әдістеменің 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 индексін (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.

Бағалы қағаздар нарығын  
реттеу және дамыту  
мәселелері бойынша  
өзгерістер енгізілетін  
Қазақстан Республикасы  
нормативтік құқықтық  
актілерінің тізбесіне  
3-қосымша

Бағалы қағаздар нарығында  
брокерлік және (немесе)  
дилерлік  
қызметті жүзеге асыратын  
ұйымдардың сақтауға  
міндетті пруденциялық

нормативтердің мәндерін  
есептеу қағидаларына  
қосымша

**Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі**

№	Көрсеткіштің атауы	Баланс бойынша сомасы	Есепке алынатын көлемі (пайызбен)	Есептеу сомасы
1	2	3	4	5
1	Ақша және салымдардың барлығы, оның ішінде:			
1.1	Ұйымның 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	
1.4	Қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша		100	
	Ұйымның кепілдік немесе резервтік			

1.5	<p>қорларына 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</p>		100	
1.6	<p>Standard &amp; Poog's (Стандард энд Пуре) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВВ-"-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</p>		100	
1.7	<p>"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard &amp; Poog's (Стандард энд Пуре) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВВ"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік</p>		100	

	<p>агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша</p>			
1.8	<p>Бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) (Интернэшнл Секьюритис Сервисис Асошиайшн)</p>		100	
1.9	<p>Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар</p>		100	
	<p>на талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Қазақстан Республикасының</p>			

1.10

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"-тен төмен емес шетел валютасында ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады

100

1.11	<p>Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "B"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard &amp; Poor's (Стандарт 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</p>	90		
1.12	<p>Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "AA"-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 даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұ л т т ы қ валютасындағы салымдар</p>	100		
	<p>Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің</p>			

1.13	халықаралық шкаласы бойынша " ВВВ-"-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		100	



	алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар			
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	
2.5	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 ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының		90	

	<p>аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>			
2.6	<p>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 субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар</p>		95	
	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес</p>			

2.7	<p>шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды 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 заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>	60	
	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard &amp; Poog's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас</p>		

2.8	<p>деңгейдегі рейтингі немесе Standard &amp; Poog'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</p>	100		
2.9	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard &amp; Poog'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 &amp; Poog's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының</p>	85		

	з а н д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары			
2.10	Standard & Poor's (Стандард энд Пуре) агенттігінің "AA"-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 Пуре) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі б а р ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		100	
	Standard & Poor's (Стандард энд Пуре) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе			

2.12	<p>басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары</p>	90	
2.13	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " В+"-тен "В"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары</p>	80	
2.14	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі ( эмитегінде бар) бар ш е т е л д і к эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>	100	
2.15	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВ+"-тен "ВВ"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі ( эмитегінде бар) бар</p>	85	

	шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары			
2.16	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В"-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 қолхаттар – барлығы, оның ішінде:			
3.1	Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		100	
3.2	заңды тұлғалардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін акциялары		100	

	және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар			
3.3	<p>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, жария сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттарды қоспағанда, базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p>		80	
	<p>Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе</p>			



3.4	<p>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 қолхаттар</p>	60		
3.5	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВВ-"-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 эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p>	100		
	<p>Standard &amp; Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін рейтингтік</p>			

3.6	бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		80	
3.7	Standard & Poor's (Стандард энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		60	
4	Өзге бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде:			
4.1	инвестициялық қорлардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген бағалы қағаздары		70	
	активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын			

4.2	қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі кор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) (Экстейндж Трэдэд Фандс) пайлары		90	
4.3	Morningstar рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Экстейндж Трэдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (ETC) (Экстейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Экстейндж Трэдэд Ноутс) пайлары		80	
4.4	орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар		100	
	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 "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры"			

4.5	акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдігі бар, сомасы қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, осы мемлекеттік емес борыштық 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	
5.2	бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (Ұйымның үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада		100	
	бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы			

5.3	<p>проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің өтуіне байланысты туындаған (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің талаптары бойынша мерзімі өтпеген) бағалы қағаздардың номиналдық құнын төлеуге қойылатын талаптар</p>		100	
5.4	<p>Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі Ұйымның негізгі құралдары</p>		100	
6	<p>Жиынтық өтімді активтер</p>			
6.1	<p>Өтімді активтер</p>			
6.2	<p>Өтімділігі жоғары активтер</p>			
7	<p>Баланс бойынша жиынтық міндеттемелер, соның ішінде:</p>			
7.1	<p>7 күнге дейін</p>			
7.2	<p>30 күнге дейін</p>			
7.3	<p>90 күнге дейін</p>			
7.4	<p>Маржалық қамтамасыз ету бойынша міндеттемелер</p>			
8	<p>Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері</p>			
8.1	<p>ИПБ_От</p>			
8.2	<p>БД_От</p>			
8.3	<p>ЗА_ИПБ_От</p>			
9	<p>Меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициенті</p>			

10	Мерзімді өтімділік коэффициенті:			
10.1	К2-1			
10.2	К2-2			
10.3	К2-3			
10.4	К2-4			

Бағалы қағаздар нарығын  
реттеу және дамыту  
мәселелері бойынша  
өзгерістер енгізілетін  
Қазақстан Республикасы  
нормативтік құқықтық  
актілерінің тізбесіне  
4-қосымша  
Қазақстан Республикасы  
Ұлттық Банкі Басқармасының  
2018 жылғы 27 сәуірдегі  
№ 80 қаулысына  
2-қосымша

**Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі**

**1-тарау. Жалпы ережелер**

1. Осы Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі (бұдан әрі – Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабына сәйкес әзірленді және ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларын (бұдан әрі – ЕЖЗҚ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 1-ИПБ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 2-ИПБ) қоса алғанда, бағалы

қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар (бұдан әрі – брокер және (немесе) дилер) сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

## **2-тарау. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі**

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

3. Брокер және (немесе) дилердің меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$$K = (\Theta\text{ЖА} + \Theta\text{А} - M) / (M\text{КАМ} + B\text{Д\_От}), \text{ мұндағы:}$$

$\Theta\text{ЖА}$  - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімділігі жоғары активтері;

$\Theta\text{А}$  - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері;

$M$  - есеп айырысу күніне қолда бар, баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

$M\text{КАМ}$  - меншікті капиталдың брокердің және (немесе) дилердің меншікті капиталының жеткіліктілігі есебіне алынатын ең аз мөлшері:

Номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы бар брокердің және (немесе) дилердің  $M\text{КАМ}$  50 000 (елу мың) АЕК-ті;

Клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы жоқ брокердің және (немесе) дилердің  $M\text{КАМ}$ , 10 000 (он мың) АЕК-ті құрайды;

$B\text{Д\_От}$  - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел.

4. Брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел төмендегідей есептеледі:

$B\text{Д\_От} = \text{абсолютті көрсеткіш} + a * \text{салыстырмалы көрсеткіш}$ , мұнда:

абсолюттік көрсеткіш 15 000 (он бес мың) АЕК-ке тең;

салыстырмалы көрсеткіш есепті күннің алдындағы соңғы 60 (алпыс) айдағы пайда мен шығындар туралы есептің айыпақы (айыппұл, өсімпұл) бабы бойынша орташа жылдық шығыстың 15 (он бес) еселенген мөлшері ретінде есептеледі;

$a$  - операциялық тәуекелдің коэффициенті есептік күннің алдындағы соңғы 36 (отыз алты) айда брокерлер және (немесе) дилерлер жасасқан мәмілелердің\* орташа жылдық көлеміне байланысты белгіленген және кестеге сәйкес айқындалады:

Санаты	Мәмілелердің орташа жылдық көлемі (3 жыл) (теңге)	Коэффициент, $a$
1	1000 млрд-қа дейін	1

2	1000 млрд-тан 3000 млрд-қа дейін	2
3	3000 млрд-тан 5000 млрд-қа дейін	3
4	5000 млрд-тан 7500 млрд-қа дейін	5
5	7500 млрд-тан жоғары	7

\*бағалы қағаздардың ұйымдастырылған, ұйымдастырылмаған және халықаралық нарықтарында, сондай-ақ "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында (брокер және (немесе) дилер номиналды ұстаушы болған кезден басқа), валюта нарығында (банк операцияларының жекелеген түрлерін жүзеге асыратын ұйымдар үшін) жасалған мәмілелер, сондай-ақ репо ашу, "кері репо" операцияларының көлемі.

Бұл ретте, егер брокер және (немесе) дилер лицензияны алған сәттен бері мерзім жоғарыда көрсетілген мерзімнен аз кезеңді құрайтын болса, онда бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға арналған лицензияны алған сәттен бастап деректер пайдаланылады.

Бұл ретте, егер салыстырмалы көрсеткіштің мәні 3 000 (үш мың) АЕК-тен аз болса, онда салыстырмалы көрсеткіштің мәні 3 000 (үш мың) АЕК-ке тең болады.

Жасалатын мәмілелер болмаған кезде а 0-ге (нөл) тең.

Бағалы қағаздар рыногы туралы заңның 53-2-бабының 5-тармағында белгіленген жағдайларды қамтитын клиенттер алдындағы жауапкершілікті сақтандыру кезінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы жоқ брокер және (немесе) дилер абсолюттік көрсеткіштің мөлшерін сақтандыру сомасының мөлшеріне азайтады, бірақ ол абсолюттік көрсеткіш мөлшерінің 50%-нан аспауға тиіс.

5. Брокердің және (немесе) дилердің мерзімді өтімділік коэффициенттерінің ең аз 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 0 (нөл) күннен 7 (жеті) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен өтімділігі жоғары активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 7 (жеті) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері өтімділігі жоғары 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 дейінгі 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 дейінгі қалған мерзімімен жиынтық өтімді активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 90 (тоқсан) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімі 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.

Брокердің және (немесе) дилердің есеп айырысу күнгі өтімділігі жоғары және өтімді активтері Әдістеменің 6-тармағына сәйкес осындай деп танылады.

6. Брокердің және (немесе) дилердің өтімділігі жоғары активтерінің есебіне осы қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына (бұдан әрі – Қағидалар) қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің 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.

Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінің 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 тиісті көлемдерде көрсетілген активтер активтер брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері ретінде танылады.

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

1) брокердің және (немесе) дилердің міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) брокердің және (немесе) дилердің меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемдерде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда);

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) өлшемдері қор биржасы акциялар нарығының индексін (қор биржасының өкілдік тізімі) есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, брокерге және (немесе) дилерге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар жатады.

**3-тарау. Ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі**

8. ЕЖЗҚ меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$K = (\Theta A - M) / MKAM$ , мұнда:

$\Theta A$  - Әдістеменің 11-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

$M$  - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

$MKAM$  - Әдістеменің 10-тармағына сәйкес есептелген, меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын ЕЖЗҚ меншікті капиталының ең аз мөлшері.

9. ЕЖЗҚ өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$\Theta_k = \Theta A / M$ , мұнда:

$\Theta A$  - Әдістеменің 11-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

$M$  - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

10. Егер:

инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден кем болса, онда  $MKAM$  107 000 (жүз жеті мың) АЕК-ке тең ;

инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден асатын болса, онда  $MKAM$  107 000 (жүз жеті мың) АЕК + (АПУ- 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)\* 0,0001, мұнда АПУ инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтері болып табылады.

11. Қағидалардың қосымшасына сәйкес тиісті көлемдерде Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген ЕЖЗҚ-ның меншікті активтері ЕЖЗҚ-ның өтімді активтері деп танылады.

12. Әдістеменің 11-тармағында көзделген өтімді активтердің есебіне енгізілмейді:

1) ЕЖЗҚ міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) ЕЖЗҚ-ның меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздар Қағидалардың қосымшасына сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде ЕЖЗҚ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздар ЕЖЗҚ-ның өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) ЕЖЗҚ-ға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар;

3) ЕЖЗҚ-ның ірі акционерлеріне және осы сенімгерлік басқарушылардың үлестес тұлғаларына тиесілі ЕЖЗҚ-ның дауыс беретін акцияларының он және одан да көп пайызымен сенімгерлік басқарушылар шығарған бағалы қағаздар;

4) ЕЖЗҚ-ға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын екінші деңгейдегі банктердегі салымдар мен ағымдағы шоттар.

13. ЕЖЗҚ-ның меншікті активтері есебінен мәмілелер Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 32832 болып тіркелген, Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2023 жылғы 7 маусымдағы № 42 қаулысымен бекітілген Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорының және (немесе) ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларының қызметін жүзеге асыру қағидаларының 2-тарауында белгіленген тәртіппен жасалады.

**4-тарау. Ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушылардың немесе ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушылардың пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі**

14. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$$K = (\Theta_{\text{ЖА}} + \Theta_{\text{А}} - M) / (MKAM + BD_{\text{От+ИПБ}}_{\text{От+3А}}_{\text{ИПБ}}_{\text{От}}), \text{ мұнда:}$$

ӨЖА - Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын есептеу күніне қолда бар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер:

МКАМ - бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын, 440 000 (төрт жүз қырық мың) АЕК-ті құрайтын меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының ең төмен мөлшері;

БД\_От - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел;

ИПБ\_От - есепті күнге инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 0,1%;

ЗА\_ИПБ\_От - зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел, инвестициялық басқарудағы активтердің есептеу күніндегі мөлшері ретінде есептелген, ЗА УИП операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген – 4%.

15. 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншік капиталының жеткіліктілік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$$K = (\text{ӨЖА} + \text{ӨА} - \text{М}) / (\text{МКАМ} + \text{БД\_От} + \text{ИПБ\_От}),$$
 мұнда:

ӨЖА - Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын есептеу күніне қолда бар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

МКАМ - меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын, 50 000 (елу мың) АЕК-ті құрайтын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының ең аз мөлшері;

БД\_От - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел;

ИПБ\_От – есепті күнге инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 0,1%.

16. 1-ИПБ немесе 2-ИПБ мерзімді өтімділік 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 0-ден (нөлден) 7 (жеті) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне

жоғары өтімді активтердің мөлшерінің қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0-ден (нөлден) 7 (жеті) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жоғары өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

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

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

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

Инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күніне қолда бар жоғары өтімді және өтімді активтері Әдістеменің 17-тармағына сәйкес сондай деп танылады.

17. Қағидаларға қосымшаға сәйкес тиісті көлемдерде Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген активтер 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жоғары өтімді активтерінің есебіне енгізіледі: 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.

Қағидаларға қосымшаға сәйкес бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген активтер 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері ретінде танылады: 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.

18. Әдістеменің 17-тармағында көзделген 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жоғары өтімді және өтімді активтерінің есебіне мыналар енгізілмейді:

1) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды есепке алмағанда ) Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) өлшемдері қор биржасының акциялар нарығының индексін есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, 1-ИПБ немесе 2-ИПБ-ге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар (қор биржасының өкілдік тізімі).

Бағалы қағаздар нарығын  
реттеу және дамыту  
мәселелері бойынша  
өзгерістер енгізілетін  
Қазақстан Республикасы  
нормативтік құқықтық  
актілерінің тізбесіне  
5-қосымша  
Қазақстан Республикасы  
Ұлттық Банкі Басқармасының  
2018 жылғы 29 қарашадағы  
№ 300 қаулысына  
2-қосымша

**Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды анықтау әдістемесі**

1. Осы Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды анықтау әдістемесі "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңына ( бұдан әрі - Заң) сәйкес әзірленді.

2. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті және (немесе) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың қаржылық жағдайының нашарлауына әсер ететін факторларды анықтау ( бұдан әрі - ұйымдастыру) мынадай әдістеме бойынша жүзеге асырылады:

1) қатарынан 3 (үш) ай ішінде меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициентінің Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген "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 қаулысында (бұдан әрі – № 79 қаулы) және Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17005 болып тіркелген "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысында (бұдан әрі – № 80 қаулы) белгіленген меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициентінің мәнінен 0,3 тармаққа асатын немесе одан төмен деңгейге дейін екі және одан да көп рет төмендеуі;

2) бастапқы мәні № 79 қаулыда және № 80 қаулыда белгіленген меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициентінің мәнінен 0,3 тармаққа асатын деңгейден төмен болған кезде меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициентінің төмендеуі;

3) қатарынан 3 (үш) ай ішінде жиынтық өтімді активтер көлемінің 20 (жиырма) және одан көп пайызға жиынтық төмендеуі;

4) қатарынан 3 (үш) ай ішінде шығынды қызмет.