

О внесении изменений и дополнений в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 января 2005 года N 17 "Об установлении пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг"

Утративший силу

Постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 25 февраля 2006 года N 66. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 3 апреля 2006 года N 4172. Утратило силу - от 17 июня 2006 года N 132 (вводится в действие по истечении 14 дней со дня гос.регистрации в МЮ РК и его действие распространяется на отношения, возникшие с 1 июля 2006 года)

Постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 25 февраля 2006 года N 66 утратило силу - от 17 июня 2006 года N 132 (вводится в действие по истечении 14 дней со дня гос.регистрации в МЮ РК и его действие распространяется на отношения, возникшие с 1 июля 2006 года).

В соответствии с подпунктами 11), 15) пункта 2 статьи 3, пунктом 4 статьи 45, статьей 49 Закона Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг" и подпунктами 5), 6) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан "О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций", Правление Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - Агентство)

ПОСТАНОВЛЯЕТ:

1. Внести в постановление Правления Агентства от 29 января 2005 года N 17 "Об установлении пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 3484), с изменениями и дополнениями, внесенными постановлением Правления Агентства от 25 июня 2005 года N 221 (

зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 3751), постановлением Правления Агентства от 27 августа 2005 года N 310 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 3868), постановлением Правления Агентства от 29 октября 2005 года N 387 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 3952), постановлением Правления Агентства от 26 ноября 2005 года N 414 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 3994) следующие изменения и дополнения:

в Правилах расчета пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, утвержденных указанным постановлением:

пункт 2 после слов "уполномоченного органа" дополнить словами "по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - уполномоченный орган)";

в пункте 3:

абзац первый после слов "(далее - Организации)" дополнить словами ", организации, осуществляющей брокерскую и дилерскую деятельность с правом ведения счетов клиента в качестве номинального держателя (далее - Брокер и (или) дилер)";

подпункты 5), 11-1), 13) после слова "Организации" дополнить словами ", Брокеру и (или) дилеру";

подпункт 14) после слов "к Фонду, Организации", "Фонда, Организации" дополнить словами ", Брокеру и (или) дилеру" и ", Брокера и (или) дилера";

пункт 4 после слова "Организации" дополнить словами ", Брокера и (или) дилера";

в пунктах 6, 8, 9, 11, 12 слова "брокерско-дилерской" заменить словами "брокерской и дилерской";

пункт 11-1 исключить;

дополнить главой 4-1 следующего содержания:

"Глава 4-1. Порядок расчета пруденциальных нормативов для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность с правом ведения счетов клиента в качестве номинального держателя

12-1. Коэффициент достаточности собственного капитала при совмещении Брокером и (или) дилером деятельности с деятельностью по управлению инвестиционным портфелем и осуществлении им банковских операций, определенных нормативным правовым актом уполномоченного органа, рассчитывается по следующей формуле:

$K_1 = (ЛА-О)/МРСК$, где

ЛА - ликвидные активы Брокера и (или) дилера;

О - совокупные обязательства Брокера и (или) дилера, за исключением субординированного долга за минусом выкупленного собственного субординированного долга Брокера и (или) дилера, который не превышает пятьдесят процентов суммы:

уставного капитала за минусом изъятых капитала;
дополнительного капитала;

нераспределенного чистого дохода прошлых лет (в том числе фонды, резервы, сформированные за счет чистого дохода прошлых лет).

Субординированный долг - это необеспеченное обязательство Брокера и (или) дилера, соответствующее следующим условиям:

- 1) не является обязательством на предъявителя;
- 2) не является залоговым обеспечением по требованиям Брокера и (или) дилера или аффилированных с ним лиц;
- 3) при ликвидации Брокера и (или) дилера удовлетворяется в последнюю очередь удовлетворения требований кредиторов;
- 4) может быть погашено (полностью или частично) Брокером и (или) дилером, в том числе досрочно только по инициативе Брокера и (или) дилера, при условии, что такое погашение в соответствии с заключением уполномоченного органа впоследствии не может привести к несоблюдению Брокером и (или) дилером установленных настоящими Правилами значений пруденциальных нормативов.

Субординированный долг Брокера и (или) дилера - это субординированный долг, имеющий срок привлечения более пяти лет до начала погашения.

Облигации признаются субординированным долгом Брокера и (или) дилера только после утверждения уполномоченным органом отчета об итогах размещения выпуска облигаций в установленном законодательством Республики Казахстан порядке.

Субординированный долг Брокера и (или) дилера исключается из совокупных обязательств:

в течение срока более пяти лет до начала погашения долга - в полной сумме долга,

в течение пяти лет, оставшихся до начала погашения долга:

- 1-й год - 100 процентов суммы субординированного долга,
- 2-й год - 80 процентов суммы субординированного долга,
- 3-й год - 60 процентов суммы субординированного долга,
- 4-й год - 40 процентов суммы субординированного долга,

5-й год - 20 процентов суммы субординированного долга.

Субординированным долгом Брокера и (или) дилера также признается заем Брокера и (или) дилера, привлеченный от Европейского Банка Реконструкции и Развития или Азиатского Банка Развития либо Международной Финансовой Корпорации, соответствующий требованиям настоящего пункта, за исключением подпункта 3), если договором предусмотрена возможность досрочного (полного или частичного) погашения займа по инициативе заемщика при условии, что такое погашение в соответствии с заключением уполномоченного органа впоследствии не может привести к ухудшению финансового положения Брокера и (или) дилера и нарушению требований действующего законодательства Республики Казахстан;

МРСК - минимальный размер собственного капитала Брокера и (или) дилера.
МРСК = 1 миллиард тенге.

Если стоимость активов, принятых в управление, составляет более 40 миллиардов тенге, то минимальный размер собственного капитала Брокера и (или) дилера рассчитывается по формуле:

$$\text{МРСК} = (1 \text{ миллиард тенге} + (\text{АПУ} - 40 \text{ миллиардов тенге}) * 0,0002)$$

АПУ - активы, принятые в управление.

Максимальное значение МРСК не должно превышать 1,6 миллиардов тенге.

12-2. При совмещении Брокером и (или) дилером деятельности с деятельностью по управлению инвестиционным портфелем и осуществлению им банковской заемной операции, рассчитывается пруденциальный норматив "Максимальный размер риска на одного заемщика".

Максимальный размер риска на одного заемщика рассчитывается как сумма:

1) требований Брокера и (или) дилера к заемщику, учитываемых на балансе Брокера и (или) дилера;

2) требований Брокера и (или) дилера к заемщику, списанных с баланса Брокера и (или) дилера в течение последних пяти лет, предшествующих текущему году;

3) за минусом суммы обеспечения по обязательствам заемщика в виде: вкладов, предоставленных в качестве обеспечения данного обязательства; государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан;

аффинированных драгоценных металлов;

гарантий Правительства Республики Казахстан;

гарантий банков, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "А" (по классификации рейтингового агентства Standard & Poor's) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств.

Отношение размера риска Брокера и (или) дилера на одного заемщика по его обязательствам к собственному капиталу, рассчитанному как ЛА-О, Брокера и (или) дилера не должно превышать 0,25.";

в пункте 13 слова "по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - уполномоченный орган)" исключить;

в п у н к т е 1 4 :

слова "пруденциального норматива" заменить словами "пруденциальных нормативов";

после слова "Управляющего" дополнить словами "и Брокера и (или) дилера";

пункты 15-1, 15-3, 20, 20-1 и 20-2 после слов "Организации", "Организация", "Организацией" дополнить, соответственно, словами ", Брокера и (или) дилера", "Брокер и (или) дилер", "Брокером и (или) дилером";

в пункте 20 слово "календарных" заменить словом "рабочих";

в п р и л о ж е н и и 4 :

в таблице "Расчет пруденциального норматива "Коэффициент достаточности собственного капитала" (K_1) для Управляющего по состоянию на "___" _____

2 0 _ _ г о д а " :

наименование таблицы после слова "Управляющего" дополнить словами "и Брокера и (или) дилера";

строки 4, 10.1, 12, 13, 13.1, 13.2, 14, 14.1, 14.2, 14.3, 15 после слова "Управляющему", "Управляющего" дополнить, соответственно, словами "Брокеру и (или) дилеру" и "Брокера и (или) дилера";

строку 11 изложить в следующей редакции:

11.	Аффинированные драгоценные металлы		100	
-----	------------------------------------	--	-----	--

в строке 17 слова "по балансу" исключить;

в п р и л о ж е н и и 5 :

в таблице "Дополнительные сведения для расчета пруденциального норматива "Коэффициент достаточности собственного капитала" (K_1) для Управляющего по состоянию на "___" _____20__года":

наименование таблицы изложить в следующей редакции:

"Дополнительные сведения для расчета пруденциальных нормативов для Управляющего и Брокера и (или) дилера по состоянию на "___" _____20__года"

строки 8006, 8007, 8012, 8013, 8014 после слов "Управляющему", "Управляющего" дополнить, соответственно, словами "Брокеру и (или) дилеру", "Брокера и (или) дилера";

строку 8009 в изложить в следующей редакции:

--	--	--	--	--

8009	Аффинированные драгоценные металлы	
------	------------------------------------	--

дополнить строками 8016, 8017, 8018, 8019, 8020, 8021, 8022, 8023 следующего содержания:

8016	Сумма субординированного долга до начала погашения которого остался один год	
8017	Сумма субординированного долга до начала погашения которого осталось два года	
8018	Сумма субординированного долга до начала погашения которого осталось три года	
8019	Сумма субординированного долга до начала погашения которого осталось четыре года	
8020	Сумма субординированного долга до начала погашения которого осталось пять лет и более	
8021	Прочая долгосрочная кредиторская задолженность	
8022	Совокупная задолженность одного заемщика, рассчитанная в соответствии с подпунктами 1), 2) пункта 12-2 настоящих Правил	
8023	Совокупная сумма обеспечения по обязательствам заемщика, рассчитанная в соответствии с подпунктом 3) пункта 12-2 настоящих Правил	

2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении четырнадцати дней со дня государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан.

3. Департаменту надзора за субъектами рынка ценных бумаг и накопительными пенсионными фондами (Токобаев Н.Т.):

1) совместно с Юридическим департаментом (Байсынов М.Б.) принять меры к государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан настоящего постановления;

2) в десятидневный срок со дня принятия настоящего постановления довести его до сведения заинтересованных подразделений Агентства, Объединения юридических лиц "Ассоциация финансистов Казахстана", Объединения юридических лиц "Ассоциация управляющих активами".

4. Отделу международных отношений и связей с общественностью (Пернебаев Т.Ш.) принять меры к публикации настоящего постановления в средствах массовой информации Республики Казахстан.

5. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Агентства Бахмутову Е.Л.

Председатель

© 2012. РГП на ПХВ «Институт законодательства и правовой информации Республики Казахстан»
Министерства юстиции Республики Казахстан