



Об утверждении Правил осуществления Национальным Банком Республики Казахстан операций РЕПО

Утративший силу

Постановление Правление Национального Банка Республики Казахстан от 5 февраля 2007 № 10. Зарегистрирован в Министерстве юстиции Республики Казахстан 16 апреля 2007 года № 4616. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 сентября 2009 года № 89

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 25.09.2009 № 89.

В целях совершенствования нормативной правовой базы, регулирующей порядок проведения операций РЕПО с ценными бумагами на внутреннем рынке Республики Казахстан Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. Утвердить прилагаемые Правила осуществления Национальным Банком Республики Казахстан операций РЕПО.

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

3. Со дня введения в действие настоящего постановления признать утратившим силу постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 3 июля 1999 года N 160 "Об утверждении Правил проведения Национальным Банком Республики Казахстан операций РЕПО и обратного РЕПО с государственными ценными бумагами Республики Казахстан", зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под N 867.

4. Департаменту монетарных операций (Герасименко Ю.В.):

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

2) в десятидневный срок со дня государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан настоящего постановления довести его до сведения заинтересованных подразделений и территориальных

филиалов Национального Банка Республики Казахстан, Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций и отдельных субъектов финансового рынка.

5. Контроль над исполнением настоящего постановления возложить на Заместителя Председателя Национального Банка Республики Казахстан Сартбаева М.М.

П р е д с е д а т е л ь

Национального Банка

У т в е р ж д е н ы
постановлением Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 5 февраля 2007 года N 10

Правила осуществления Национальным Банком Республики Казахстан операций РЕПО

Настоящие Правила разработаны в целях определения порядка осуществления Национальным Банком Республики Казахстан (далее - Национальный Банк) операций РЕПО.

Глава 1. Общие положения

1. В настоящих Правилах используются следующие понятия:

- 1) депозитарий - центральный депозитарий;
- 2) депонент - организация, являющаяся клиентом депозитария;
- 3) замещение - право покупателя ценных бумаг по операции РЕПО при наступлении даты закрытия РЕПО заменить ценные бумаги, проданные ему в день открытия РЕПО, другими ценными бумагами на условиях, определенных настоящими Правилами;
- 4) контрагент - участник сделки, с которым Национальный Банк осуществляет операцию РЕПО;
- 5) купонная облигация - облигация, по которой владельцу выплачивается номинальная стоимость в момент погашения, а так же вознаграждение, период и количество выплат по которому указан в сертификате данной ценной бумаги;
- 6) операция РЕПО - операция, состоящая из двух одновременно заключаемых сделок: открытие РЕПО, предполагающее первоначальную продажу/покупку ценных бумаг с обязательством участников в обусловленное в будущем время при закрытии РЕПО осуществить обратную покупку/продажу ценных бумаг на заранее оговоренных условиях;

7) операция прямого РЕПО - операция РЕПО, при открытии которой Национальный Банк осуществляет продажу ценных бумаг контрагенту с обязательством обратного выкупа данных или иных годных к замещению ценных бумаг;

8) операция обратного РЕПО - операция РЕПО, при открытии которой Национальный Банк осуществляет покупку ценных бумаг у контрагента с обязательством обратной продажи данных или иных годных к замещению ценных бумаг;

9) операция безотзывного РЕПО - операция РЕПО без права прерывать сделку до закрытия РЕПО;

10) операция отзывного РЕПО - операция РЕПО с правом контрагента уменьшить срок закрытия РЕПО, но не ранее, чем через три рабочих дня после заключения сделки, с одновременным изменением ставки вознаграждения по согласованию с Национальным Банком;

11) ставка РЕПО - ставка вознаграждения, исчисляемая в процентах годовых, устанавливаемая Советом директоров Национального Банка с учетом рекомендаций Технического Комитета по денежно-кредитной и валютной политике Национального Банка;

12) торговое подразделение - управление дилинговых операций подразделения монетарных операций Национального Банка, уполномоченное на совершение сделок с ценными бумагами;

13) управление расчетов - управление расчетов и кредитования подразделения монетарных операций Национального Банка, осуществляющее ввод данных по сделкам в автоматизированную информационную систему "Кубаж-3Ц";

14) уполномоченный департамент - подразделение монетарных операций Национального Банка;

15) уполномоченное управление - подразделение учета монетарных операций Национального Банка, уполномоченное на осуществление расчетов по сделкам между контрагентами и Национальным Банком;

16) цена открытия РЕПО - цена ценной бумаги, являющейся предметом операции РЕПО, по которой осуществляется открытие РЕПО;

17) цена закрытия РЕПО - цена ценной бумаги, являющейся предметом операции РЕПО, по которой осуществляется закрытие РЕПО.

2. Национальный Банк осуществляет операции РЕПО как на организованном (биржевом), так и на неорганизованном (межбанковском) рынке.

3. Операции РЕПО на организованном (биржевом) рынке осуществляются Национальным Банком в соответствии с внутренними документами фондовой биржи.

4. Операции РЕПО на неорганизованном (межбанковском) рынке осуществляются Национальным Банком в соответствии с настоящими Правилами на основании заключенного с контрагентом соглашения.

5. Контрагентом Национального Банка на организованном (биржевом) рынке является фондовая биржа, на неорганизованном (межбанковском) рынке - депонент.

6. Срок операций РЕПО составляет один и более календарных дней. Количество дней в году принимается равным 365 календарным дням.

7. Все операции обратного РЕПО являются операциями безотзывного РЕПО.

8. Вид ценной бумаги, участвующей при проведении операций прямого и обратного РЕПО, определяется Национальным Банком.

9. В течение срока операции РЕПО покупатель ценных бумаг, являющихся предметом операции РЕПО, вправе распоряжаться данными ценными бумагами.

10. Национальный Банк самостоятельно принимает решение о необходимости осуществления операций РЕПО на организованном (биржевом) и неорганизованном (межбанковском) рынках в зависимости от ситуации на денежном рынке.

Глава 2. Порядок осуществления операции РЕПО

11. В день получения от контрагента предложения об осуществлении с ним операции РЕПО, дилер торгового подразделения сообщает руководству уполномоченного департамента/руководству торгового подразделения в целях получения подтверждения о возможности осуществления операции РЕПО. Подтверждением возможности осуществления операции РЕПО является разрешительная виза руководства уполномоченного департамента/руководства торгового подразделения на письме контрагента с предложением об осуществлении операции РЕПО.

12. Письмо контрагента с предложением об осуществлении операции РЕПО включает следующую информацию:

- 1) срок операции РЕПО (дату открытия и дату закрытия РЕПО);
- 2) вид операции РЕПО (прямое/обратное, отзывное/безотзывное);
- 3) предмет операции РЕПО (вид ценных бумаг, срок погашения);
- 4) ставка вознаграждения;

5) сумма операции РЕПО.

13. Сделка открытия РЕПО предполагает первоначальный перевод ценных бумаг с лицевого счета продавца ценных бумаг на лицевой счет покупателя ценных бумаг с последующим переводом денег от покупателя ценных бумаг продавцу ценных бумаг по цене открытия РЕПО.

14. В целях унификации расчета цены открытия РЕПО на организованном (биржевом) и неорганизованном (межбанковском) рынках расчет цены открытия РЕПО на неорганизованном рынке осуществляется в соответствии с методикой оценки ценных бумаг фондовой биржи.

15. Сделка закрытия РЕПО предполагает в обусловленное в будущем время обратный перевод ценных бумаг с лицевого счета покупателя ценных бумаг на лицевой счет продавца ценных бумаг с последующим переводом денег от продавца ценных бумаг покупателю ценных бумаг по цене закрытия РЕПО.

16. Закрытие РЕПО проводится не позднее, чем за пять календарных дней до даты погашения ценных бумаг, являющихся предметом операции РЕПО.

17. Цена закрытия РЕПО, количество ценных бумаг при совершении операций РЕПО и сумма сделки рассчитываются с учетом ставки РЕПО в соответствии с внутренними документами фондовой биржи.

18. При проведении операции РЕПО оформляется паспорт сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО (далее - паспорт сделки) по форме согласно приложению 1 к настоящим Правилам.

Паспорт сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО визируется дилером торгового подразделения, руководством торгового подразделения, руководством уполномоченного департамента и передается через управление расчетов с визами специалиста и руководителя управления расчетов в уполномоченное управление для осуществления расчетов по операции РЕПО.

19. Национальный Банк и контрагент действуют в соответствии с соглашением о проведении операций РЕПО, предполагающие перечисление ценных бумаг и денег между участниками сделки РЕПО в размерах и в сроки, согласованные сторонами.

Глава 3. Порядок замещения предмета РЕПО и осуществления операции отзывного РЕПО

20. В день закрытия РЕПО участник сделки, являвшийся покупателем ценных бумаг при открытии РЕПО, вправе на основании соглашения к сделке РЕПО по замещению ценных бумаг по операции РЕПО, заключенного с продавцом ценных бумаг по форме согласно приложению 2 к настоящим Правилам, заменить ценные бумаги, проданные ему при открытии РЕПО, другими ценными бумагами, аналогичными или превосходящие следующие их характеристики:

- 1) вид ценных бумаг;
- 2) доходность к погашению на дату закрытия РЕПО.

Срок погашения ценных бумаг не должен превышать срок погашения ценных бумаг, проданных покупателю при открытии РЕПО.

21. Покупатель купонных облигаций перечисляет на банковский счет продавца сумму вознаграждения в сроки, предусмотренные соглашением к сделке РЕПО по выплате вознаграждения по купонным облигациям, заключенным между продавцом и покупателем по форме согласно приложению 3 к настоящим Правилам.

22. При принятии решения контрагента об уменьшении срока операции отзывного РЕПО, контрагент высылает в Национальный Банк письмо-уведомление о прерывании операции отзывного РЕПО и взамен предыдущего паспорта сделки оформляется новый паспорт сделки по форме согласно приложению 1 к настоящим Правилам и передается в уполномоченное управление для осуществления расчетов по операции РЕПО.

23. При уменьшении срока размещения операции отзывного РЕПО ставка вознаграждения пересчитывается согласно приложению 4 к настоящим Правилам.

24. Уведомление о прерывании операции отзывного РЕПО принимается Национальным Банком от контрагента до 16 часов алматинского времени.

Глава 4. Заключительные положения

25. Вопросы, не урегулированные настоящими Правилами, разрешаются в порядке, установленном законодательством Республики Казахстан.

П р и л о ж е н и е 1
к П р а в и л а м о с у щ е с т в л е н и я
Н а ц и о н а л ь н ы м Б а н к о м
Р е с п у б л и к и К а з а х с т а н
операций РЕПО

Паспорт сделки по операциям прямого (обратного)
РЕПО N ____ от " __ " _____ 20__ года

Контрагент: _____ Тип ценной бумаги: _____

Национальный идентификационный номер эмиссии	Дата эмиссии	Дата погашения	Дата открытия	Дата закрытия	Срок операции, дней
1	2	3	4	5	6

продолжение таблицы

Цена открытия, тенге	Цена закрытия, тенге	Количество, штук	Объем открытия, тенге	Объем закрытия, тенге	Процентная ставка
7	8	9	10	11	12

Общее количество ценных бумаг: _____ штук

Общий объем открытия РЕПО _____ тенге

Общий объем закрытия РЕПО _____ тенге

Доход по операциям обратного (прямого) РЕПО _____ тенге

Средневзвешенная ставка РЕПО _____ процентная ставка

Средневзвешенный срок РЕПО _____ дней

Руководитель _____ подразделения
монетарных операций _____ (Фамилия и инициалы)
(подпись)

Руководитель _____
торгового подразделения _____ (Фамилия и инициалы)
(подпись)

Дилер _____
торгового подразделения _____ (Фамилия и инициалы)
(подпись)

Руководитель _____
управления расчетов _____ (Фамилия и инициалы)
(подпись)

Специалист _____
управления расчетов _____ (Фамилия и инициалы)
(подпись)

Приложение 2
к Правилам осуществления
Национальным Банком
Республики Казахстан
операций РЕПО

" ____ " _____ 20__ год
(Дата регистрации)

N _____
(Номер регистрации)

Соглашение N _____
к сделке РЕПО N ____ от " ____ " _____ 20__ года
по замещению ценных бумаг по операции РЕПО

Настоящее Соглашение РЕПО заключено между _____

_____,
(наименование участника рынка ценных бумаг и его регистрационный код)
именуемым в дальнейшем "Продавец", с одной стороны, и _____

_____,
(наименование участника рынка ценных бумаг и его регистрационный код)

именуемым в дальнейшем "Покупатель", с другой стороны, о н и ж е с л е д у ю щ е м :

1. Покупатель обязуется заменить ценные бумаги, купленные им согласно паспорту сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО N _____ от "___" _____ 20__ года, следующими бумагами:

- 1) номер и дата эмиссии _____;
- 2) количество ценных бумаг _____;
- 3) цена закрытия составляет _____;
- 4) доходность к погашению _____;
- 5) срок до погашения _____;
- 6) накопленный купон _____.

Доходность к погашению на дату закрытия РЕПО должна быть не менее, чем доходность к погашению ценных бумаг, проданных Покупателю при открытии РЕПО, и срок погашения не более, чем срок погашения ценных бумаг, проданных Покупателю при открытии РЕПО.

2. В дату закрытия РЕПО Продавец обязуется, согласно паспорту сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО N _____ от "___" _____ 20__ года, выкупить ценные бумаги, указанные в пункте 1 настоящего Соглашения.

3. Условия сделки в паспорте сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО N ___ от "___" _____ 20__ года остаются неизменными в части, не измененной настоящим Соглашением.

4. Настоящее Соглашение составлено в четырех экземплярах - два на казахском и два на русском языках, имеющих одинаковую юридическую силу.

Места нахождения и реквизиты Сторон:

Продавец

Покупатель

Руководитель

Руководитель

(подпись руководителя)

(подпись руководителя)

П р и л о ж е н и е 3

к Правилам осуществления

Национальным Банком

Республики Казахстан

операций РЕПО

" ____ "

20__ год

(Дата

регистрации)

N

(Номер регистрации)

С о г л а ш е н и е N _____
к сделке РЕПО N _____ от "_____" _____ 20__ года
по замещению ценных бумаг по операции РЕПО

Настоящее Соглашение РЕПО заключено между _____

_____,
(наименование участника рынка ценных бумаг и его регистрационный код)
именуемым в дальнейшем "Продавец", с одной стороны, и _____

_____,
(наименование участника рынка ценных бумаг и его регистрационный код)
именуемым в дальнейшем "Покупатель", с другой стороны, о
н и ж е с л е д у ю щ е м .

1. Покупатель обязуется в течение срока операции РЕПО переводить на банковский счет Продавца все суммы вознаграждения по ценным бумагам, по которым проводится операция РЕПО, в день поступления от эмитента в соответствии со следующими данными:

Номер эмиссии	Дата эмиссии	Дата выплаты вознаграждения	Количество ценных бумаг	Сумма выплаты вознаграждения по одной ценной бумаге, в тенге	Общая сумма вознаграждения
1	2	3	4	5	6

2. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Покупателем обязательств, предусмотренных пунктом 1 настоящего Соглашения, Покупатель уплачивает Продавцу неустойку в размере 50 (пятидесяти) процентов от ставки рефинансирования за каждый день просрочки платежа.

3. Условия сделки в паспорте сделки по операциям прямого (обратного) РЕПО N ___ от "_____" _____ 20__ года остаются неизменными в части, не измененной настоящим Соглашением.

4. Настоящее Соглашение составлено в четырех экземплярах - два на казахском и два на русском языках, имеющих одинаковую юридическую силу.

Места нахождения и реквизиты Сторон:

Пр о д а в е ц

П о к у п а т е л ь

Руководитель

Руководитель

(подпись руководителя)

(подпись руководителя)

П р и л о ж е н и е 4

к Правилам осуществления

Национальным Банком

Р е с п у б л и к и К а з а х с т а н

операций РЕПО

Порядок пересчета ставки вознаграждения по
операциям отзывного РЕПО при уменьшении
срока размещения операции отзывного РЕПО

$$Д2 = \left(\left(1 + \frac{Д1}{100} \right)^{\frac{T2}{T1}} - 1 \right) * 100,$$

где Д2 - ставка, пересчитываемая при уменьшении срока операции отзывного РЕПО (в процентах);

Д1 - первоначально оговоренная ставка РЕПО (в процентах);

T2 - новый срок операции отзывного РЕПО (в днях);

T1 - первоначально оговоренный срок операции отзывного РЕПО (в днях).