

**О внесении дополнений и изменений в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 марта 2010 года № 41 "Об утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организатора торгов"**

Постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 октября 2010 года № 160. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 3 декабря 2010 года № 6661

В целях совершенствования нормативных правовых актов Правление Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - Агентство) **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. Внести в постановление Правления Агентства от 29 марта 2010 год № 41 "Об утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организатора торгов" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 6207) следующие дополнения и изменения:

в Правилах расчета пруденциальных нормативов для организатора торгов, утвержденных указанным постановлением:

дополнить пунктом 1-1 следующего содержания:

"1-1. В настоящих Правилах используются следующие понятия:

1) специализированные торги - биржевые торги по размещению, продаже, выкупу или приобретению финансового инструмента с единственным продавцом (покупателем), который размещает, продает (выкупает, приобретает) финансовый инструмент;

2) гарантийный фонд - фонд, который формируется из гарантийных взносов членов организатора торгов в соответствии с внутренними документами организатора торгов, предназначенный для покрытия обязательств участника (участников) торгов в случае его (их) неплатежеспособности;

3) гарантийный взнос - взнос, уплачиваемый членом организатора торгов и являющийся обязательным условием для его допуска и допуска обслуживаемых им торговых членов к участию в торгах, проводимых организатором торгов;

4) маржевой счет - счет, открываемый организатором торгов на имя клирингового члена с целью учета сумм, уплачиваемых участниками биржевых торгов по срочным контрактам пропорционально количеству приобретенных (проданных) срочных контрактов и используемых для обеспечения обязательств по срочным контрактам, которые рассчитываются в соответствии с внутренними документами организатора

т о р г о в ;

5) срочный контракт - договор на абсолютную или условную покупку-продажу финансового инструмента с отсроченным исполнением на условиях, установленных внутренними документами организатора торгов;

6) резервный фонд - фонд, который формируется из собственных средств организатора торгов в соответствии с его внутренними документами, предназначенный для покрытия обязательств участников торгов;

7) участник торгов - член организатора торгов, принимающий участие в торгах, проводимых организатором торгов.;"

пункты 8, 9 изложить в следующей редакции:

"8. Коэффициент текущей ликвидности организатора торгов ( $K_2$ ) рассчитывается на среднемесячной основе по следующей формуле:

$$K_2 = \text{ЛА} / (\text{О} + \text{Т} + \text{У}),$$

г д е :  
ЛА - размер высоколиквидных активов организатора торгов, указанных в пункте 9 настоящих Правил;

О — сумма обязательств организатора торгов перед участниками торгов, рассчитанная из суммы денег на корреспондентских счетах организатора торгов, формируемой за счет суммы предварительной оплаты до начала торгов иностранными валютами, остатка денежных средств по завершению торгов иностранными валютами, суммы гарантийных взносов по специализированным торгам, суммы на маржевых счетах, размера гарантийного фонда, который формируется за счет гарантийных взносов участников рынка срочных контрактов;

Т — сложившаяся по результатам торгов сумма нетто-требований участников торгов к организатору торгов, по которым организатор торгов несет ответственность собственными средствами. Сумма нетто-требований участников торгов к организатору торгов (Т) рассчитывается в соответствии с пунктом 9-1 настоящих Правил;

У - сумма максимального ущерба, которая подлежит возмещению организатором торгов членам организатора торгов по всем соответствующим категориям членства в результате наступления технического сбоя при проведении торгов в соответствующих секторах рынка, установленная внутренними документами организатора торгов.

9. В расчет высоколиквидных активов включаются:

1) деньги в кассе, учитываемые в размере ста процентов;

2) аффинированные драгоценные металлы, учитываемые в размере ста процентов;

3) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и (или) Национальным Банком Республики Казахстан, ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", учитываемые в размере ста процентов.

Ценные бумаги, указанные в данном подпункте, включаются в расчет высоколиквидных активов, за исключением ценных бумаг, проданных организатором торгов на условиях их обратного выкупа или переданных в залог или обремененных иным образом в соответствии с законодательством Республики Казахстан;

4) деньги на текущих и корреспондентских счетах и вклады в Национальном Банке Республики Казахстан, учитываемые в размере ста процентов, за исключением вознаграждения по указанным вкладам и денег, перечисленных участниками торгов на корреспондентский счет организатора торгов для участия в торгах и (или) во исполнение своих обязательств по заключенным на торгах сделкам;

5) деньги на текущих и корреспондентских счетах, вклады до востребования и срочные вклады в банках второго уровня Республики Казахстан и банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, учитываемые в размере ста процентов, за исключением вознаграждения по указанным вкладам и денег, перечисленных участниками торгов на корреспондентский счет организатора торгов для участия в торгах и (или) во исполнение своих обязательств по заключенным на торгах сделкам;

6) деньги на текущих и корреспондентских счетах, вклады до востребования и срочные вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг от "BB+" до "BB-" по международной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBBB-" до "kzBB" по национальной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, учитываемые в размере восьмидесяти процентов от суммы вкладов, за исключением вознаграждения по указанным вкладам и денег, перечисленных участниками торгов на корреспондентский счет организатора торгов для участия в торгах и (или) во исполнение своих обязательств по заключенным на торгах сделкам;

7) деньги на текущих и корреспондентских счетах, вклады до востребования и срочные вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг от "B+" до "B" по международной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBB-" до "kzB+" по национальной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, учитываемые в размере шестидесяти процентов, за исключением вознаграждения по указанным вкладам и денег, перечисленных участниками торгов на корреспондентский счет организатора торгов для участия в торгах и (или) во исполнение своих обязательств по заключенным на торгах сделкам."

дополнить пунктом 9-1 следующего содержания:

"9-1. Сумма нетто-требований участников торгов к организатору торгов (Т) рассчитывается по следующей формуле:

$$T = \sum_{i=1}^n (C_i - Q_i),$$

где:

n - количество членов организатора торгов по всем категориям членства;  
C<sub>i</sub> - выраженные в тенге неурегулированные требования i-го члена каждой категории организатора торгов к организатору торгов по сделкам, которые заключены в соответствующем данной категории членства секторе торговой системы организатора торгов;

Q<sub>i</sub> - выраженные в тенге неурегулированные обязательства i-го члена каждой категории организатора торгов к организатору торгов по сделкам, которые заключены в соответствующем данной категории членства секторе торговой системы организатора торгов.

Если для i-го члена одной категории организатора торгов разность между его неурегулированными требованиями (C<sub>i</sub>) и обязательствами (Q<sub>i</sub>) составляет отрицательную величину, то нетто-требование этого члена по данной категории равно нулю.

Если валютой исполнения обязательства (требования) не является тенге, эквивалент в тенге данного обязательства (требования) рассчитывается по средневзвешенному биржевому курсу данной валюты к тенге.

Если рассчитанное значение Т больше размера сформированного из средств организатора торгов резервного фонда, Т приравнивается к размеру данного резервного фонда."

пункт 10 изложить в следующей редакции:

"10. Организатор торгов производит расчеты значения коэффициента K<sub>1</sub> в соответствии с приложениями 1, 2 и 3 к настоящим Правилам, а также расчет показателей для коэффициента K<sub>2</sub>, в соответствии с приложением 4 к настоящим Правилам каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня, а также на конец каждого из выходных дней, непосредственно предшествовавших текущему рабочему дню.

Организатор торгов производит расчеты значения коэффициента K<sub>2</sub> ежемесячно по состоянию на конец последнего рабочего дня отчетного месяца."

приложение 4 изложить в редакции согласно приложению к настоящему постановлению;

в приложении 5 :  
 в таблице "Отчет о выполнении пруденциальных нормативов":  
 строки, порядковые номера 19, 20, 21 и 22, изложить в следующей редакции:

19	Среднемесячная сумма обязательств организатора торгов перед участниками торгов по деньгам участников торгов, которые находятся на корреспондентских счетах организатора торгов
20	Среднемесячная сумма нетто-требований участников торгов к организатору торгов, по которым организатор торгов несет ответственность собственными средствами
21	Среднемесячная сумма максимального ущерба членам организатора торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя
22	Количество членов организатора торгов по всем категориям членства (единиц)

дополнить строкой, порядковый номер 23, следующего содержания:

23	Коэффициент текущей ликвидности $K_2$
----	---------------------------------------

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

Действие абзаца двадцать восьмого пункта 1 настоящего постановления распространяется до 1 января 2012 года.

3. Департаменту стратегии и анализа (Абдрахманов Н.А.):  
 1) совместно с Юридическим департаментом (Сарсенова Н.В.) 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 довести настоящее постановление до сведения заинтересованных подразделений Агентства, Национального Банка Республики Казахстан, Объединения юридических лиц "Ассоциация финансистов Казахстана" и Акционерного общества "Казахстанская фондовая биржа".

4. Департаменту информационных технологий (Тусупов К.А.) в срок до 31 декабря 2010 года обеспечить доработку модуля "Небанковские организации".

5. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Агентства Алдамберген А.У.

*Председатель* *Е. Бахмутова*

П р и л о ж е н и е

к постановлению Правления

Агентства Республики Казахстан по  
 регулированию и надзору  
 финансового рынка и финансовых  
 организаций  
 от 29 октября 2010 года № 160  
 " Приложение 4  
 к Правилам расчета пруденциальных  
 нормативов для организатора торгов  
 Форма

**Расшифровка коэффициента текущей ликвидности  $K_2$**

(наименование организатора торгов)  
 по состоянию на \_\_\_\_\_ 201\_\_ года  
 (тысяч тенге)

№	Дата	Высоколик- видные активы	С у м м а обязательств организатора торгов участниками торгов деньгам участников торгов, которые находятся корреспон- дентских организатора торгов	перед по на счетах	Сумма нетто- требований участников торгов организатору торгов, которой организатор торгов ответственность собственными средствами	ущерб членам организатора торгов по всем категориям членства, по которая подлежит возмещению организатором торгов результате наступления технического сбоя
1						
2						
3						
4						
5						
6						
7						
8						
9						
10						
11						
12						
13						
14						

15				
16				
17				
18				
19				
20				
21				
22				
23				
24				
25				
26				
27				
28				
29				
30				
31				
Итого:				
Итого средне- месячная величина				
Количес- т в о рабочих дней				
Коэф- фициент текущей ликвид- ности				

Первый руководитель (на период его отсутствия - лицо, его замещающее):

\_\_\_\_\_ (должность, фамилия, имя, при наличии отчество) (подпись)

Главный бухгалтер:

\_\_\_\_\_ (фамилия, имя, при наличии отчество) (подпись)

Исполнитель:

\_\_\_\_\_ (должность, фамилия, имя, при наличии отчество) (подпись)

-----  
(номер телефона)

Дата подписания отчета " \_\_ " \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Место для печати".

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