

О внесении изменений и дополнения в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 16 июля 2007 года № 210 "О перечне и порядке приобретения базовых активов производных ценных бумаг и производных финансовых инструментов, с которыми банки второго уровня могут осуществлять брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг"

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 мая 2012 года № 193. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 2 июля 2012 года № 7778

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан» Правление Национального Банка Республики **Казахстан** **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. Внести в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 16 июля 2007 года № 210 «О перечне и порядке приобретения базовых активов производных ценных бумаг и производных финансовых инструментов, с которыми банки второго уровня могут осуществлять брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 4892) следующие изменения и дополнение:

заголовок изложить в следующей редакции:

«Об установлении перечня и порядка приобретения базовых активов производных ценных бумаг и производных финансовых инструментов, с которыми банки второго уровня могут осуществлять брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, а также случаев заключения сделок с государственными ценными бумагами и негосударственными ценными бумагами на вторичном рынке, производными финансовыми инструментами на неорганизованном рынке ценных б у м а г » ;

в преамбуле слова «В целях совершенствования нормативных правовых актов, регулирующих перечень и порядок приобретения базовых активов производных ценных бумаг и производных финансовых инструментов, с которыми банки второго уровня могут осуществлять брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг,» заменить словами «В соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан»;

пункт 2 изложить в следующей редакции:

«2. Сделки с производными финансовыми инструментами, базовые активы которых

определены пунктом 1 настоящего постановления, заключаются на организованном рынке ценных бумаг Республики Казахстан и (или) в системе организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами, указанных в приложении 4 к Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня, утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 30 сентября 2005 года № 358 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3924) (далее - Инструкция № 358), за исключением случаев заключения сделок на неорганизованном рынке при соблюдении одного из следующих условий:

1) контрапартнером - нерезидентом Республики Казахстан является организация, имеющая рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service и Fitch, либо контрапартнером - резидентом Республики Казахстан является организация, имеющая рейтинг по международной шкале не ниже «BB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «Ba3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service, либо рейтинговую оценку не ниже «kzBBB» по национальной шкале вышеуказанных рейтинговых агентств;

2) имеются котировки на покупку и (или) продажу в информационных аналитических системах Bloomberg или Reuters, либо в случае отсутствия таких котировок имеется не менее трех котировок от трех различных контрапартнеров, имеющих рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service и Fitch;

3) базовый актив производных финансовых инструментов допущен к обращению на организованном рынке ценных бумаг Республики Казахстан и (или) в системе организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами, указанных в приложении 4 к Инструкции № 358;

4) при предоставлении аудиторской организацией, осуществляющей аудит банка второго уровня, отчета, предусматривающего выражение положительного мнения аудиторской организации о :

методиках оценки банком второго уровня производного финансового инструмента; допущениях, использованных при определении стоимости производного финансового инструмента, включая информацию о допущениях, сделанных в отношении оценки кредитных потерь, процентных ставок или ставок дисконтирования; результатах стресс-тестирования, анализа чувствительности, проведенного банком второго уровня .

Банки второго уровня осуществляют брокерскую и (или) дилерскую деятельность с производными ценными бумагами и производными финансовыми инструментами, базовым активом которых является кредитный риск организаций:

1) резидентов Республики Казахстан, имеющих рейтинг по международной шкале не ниже «BB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «Ba3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service, либо рейтинговую оценку не ниже «kzBBB» по национальной шкале вышеуказанных рейтинговых агентств ;

2) нерезидентов Республики Казахстан, имеющих рейтинг по международной шкале не ниже «BBB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «BBa3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service ;

3) организаций - резидентов Республики Казахстан по выданным им займам, а также заявителей - резидентов Республики Казахстан по выпущенным гарантиям и аккредитивам . » ;

дополнить пунктом 3-1 следующего содержания:

«3-1. Сделки с государственными и негосударственными ценными бумагами на вторичном рынке заключаются банками на организованном рынке ценных бумаг, за исключением следующих случаев :

1) заключения на международных внебиржевых рынках ценных бумаг сделок по купле - продаже негосударственных долговых ценных бумаг, выпущенных (предоставленных) эмитентами - резидентами Республики Казахстан и эмитентами - нерезидентами Республики Казахстан, торгуемых в системе организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами, указанных в приложении 4 к Инструкции № 358 ;

2) заключения сделок по купле - продаже государственных ценных бумаг;

3) проведения операций «репо» на международных внебиржевых рынках ценных бумаг с юридическими лицами - нерезидентами Республики Казахстан, осуществляемых в целях привлечения ликвидности;

4) заключения сделок по купле - продаже собственных еврооблигаций;

5) реализации права преимущественной покупки;

6) выкупа размещенных акций по требованию акционера, согласно статье 27 Закона Республики Казахстан от 13 мая 2003 года «Об акционерных обществах»;

7) реализации ценных бумаг, подвергнутых фондовой биржей делистингу;

8) обмена ценных бумаг и иных обязательств эмитента на другие ценные бумаги данного эмитента, выпущенные в целях реструктуризации обязательств эмитента;

9) заключения на международных внебиржевых рынках ценных бумаг сделок по купле-продаже акций (долей участия в уставном капитале) юридических лиц - нерезидентов Республики Казахстан, находящихся в свободном обращении на международных фондовых биржах, указанных в приложении к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 84 «Об установлении Требований к приобретаемым банками, дочерними организациями

банка или банковского холдинга акциям (долям участия в уставном капитале) юридических лиц, а также совокупной стоимости долей участия банка в уставном капитале либо акций юридических лиц» (зарегистрированному в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7504);

10) заключения сделок по купле - продаже акций (долей участия в уставных капиталах) юридических лиц в соответствии со статьей 8 Закона Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан», а также сделок с негосударственными ценными бумагами в соответствии со статьей 5-1 Закона Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан».».

2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования.

П р е д с е д а т е л ь

Национального Банка

Г. Марченко