

О внесении изменений и дополнений в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 июля 2006 года № 66 "Об утверждении Правил выбора внешних управляющих активами Национального фонда Республики Казахстан"

Утративший силу

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 мая 2012 года № 181. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 19 июля 2012 году № 7803. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года № 126

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 30.05.2016 № 126 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 30 марта 1995 года «О Национальном Банке Республики Казахстан» и в целях совершенствования порядка выбора внешних управляющих активами Национального фонда Республики Казахстан Правление Национального Банка Республики Казахстан **П О С Т А Н О В Л Я Е Т :**

1. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 июля 2006 года № 66 «Об утверждении Правил выбора внешних управляющих активами Национального фонда Республики Казахстан» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов Республики Казахстан под № 4360) следующие изменения и дополнения :

в Правилах выбора внешних управляющих активами Национального фонда Республики Казахстан, утвержденных указанным постановлением:
дополнить пунктом 15-1 следующего содержания:

«15-1. Если внешний управляющий, осуществляющий внешнее управление золотовалютными активами Национального Банка, удовлетворяет критериям, установленным пунктами 19-1 и 19-2 настоящих Правил, то по решению Полномочного представителя, Председателя или Заместителя Председателя, курирующего уполномоченное подразделение, его кандидатура выносится на рассмотрение Правления Национального Банка без проведения процедур, предусмотренных пунктами 16, 17, 18 и 19 настоящих Правил.»;

пункт 35 изложить в следующей редакции:

«35. Процедура оценки эффективности работы внешнего управляющего

осуществляется в соответствии с показателями оценки эффективности работы внешнего управляющего, приведенными в приложении 4 к настоящим Правилам, и по результатам проведенного анализа Правлением Национального Банка либо Полномочным представителем принимается соответствующее решение о продолжении работы с данным внешним управляющим или о ее прекращении. Решение принимается на основе результатов внешнего управляющего за период управления в 3 (три) года.»;

дополнить пунктом 35-1 следующего содержания:

«35-1. В случае если кумулятивная сверхдоходность, полученная внешним управляющим за прошлый период, отрицательная и ее абсолютное значение превышает абсолютное значение установленного лимита показателя изменчивости отклонения доходности (tracking error) по соответствующему мандату, то на рассмотрение Правления Национального Банка выносится вопрос о расторжении соглашения о доверительном управлении с данным внешним управляющим»;

пункт 36 изложить в следующей редакции:

«36. Если происходит нарушение лимита Фонда, передаваемого во внешнее управление ввиду слияния двух действующих внешних управляющих, уполномоченное подразделение вносит на рассмотрение Полномочного представителя вопрос о расторжении соглашения с одним из двух внешних управляющих, показавшим низкий результат согласно показателям оценки эффективности работы внешнего управляющего, приведенным в приложении 4 к настоящим Правилам. Указанное нарушение устраняется в течение 4 (четырёх) месяцев со дня возникновения.»;

приложение 4 изложить в редакции согласно приложению к настоящему постановлению.

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

" С О Г Л А С О В А Н О "

М и н и с т р ф и н а н с о в

Б. Жамишев

Республики Казахстан

21 июня 2012 года

П р и л о ж е н и е

к постановлению

Правления

Национального

Банка

Республики

Казахстан

от 25 мая 2012 года № 181

П р и л о ж е н и е 4
к Правилам выбора внешних
управляющих активами
Национального фонда
Республики Казахстан

**Показатели
оценки эффективности работы внешнего управляющего**

Основной целью является оценка и выставление баллов внешним управляющим согласно количественным и качественным показателям во избежание субъективности при оценке работы внешнего управляющего.

Количественные показатели:

Информационный коэффициент (Information ration)

Проценты	Информационный коэффициент (Information ration)
>1	3 балла
0,5 - 1	2 балла
0 - 0,5	1 балла
0	0 балла
(-) 0,5 - 0	(-) 1 балла
(-) 1 - (-) 0,5	(-) 2 балла
<(-) 1	(-) 3 балла

Качественные показатели:

1) Передвижения персонала (Staff turnover);

Проценты	Передвижения персонала (Staff turnover)
> 30	(-) 0,5 балла
5 - 30	(-) 0,25 балла
0 - 5	0 балла

2) Операционный риск (Operational risk).

За каждый факт нарушения инвестиционных ограничений вследствие операционной ошибки из оценки отнимается 0,2 балла;

В случае систематического непредставления отчетности в указанные сроки из оценки отнимается 0,2 балла.

3) Соблюдение деловой этики (compliance with a Code of Business Ethics).

За каждый факт нарушения внешним управляющим деловой этики из оценки отнимается 0,5 балла;

В случае систематического несвоевременного исполнения поручений клиента из оценки отнимается 0,5 балла.

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