

Об утверждении Правил проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 июля 2018 года № 167. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 10 сентября 2018 года № 17355.

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 30 марта 1995 года "О Национальном Банке Республики Казахстан" и в целях дальнейшего совершенствования порядка проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ**:

1. Утвердить прилагаемые Правила проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики.

2. Признать утратившим силу постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 января 2016 года № 21 "Об утверждении Правил проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 13274, опубликовано 5 марта 2016 года в информационно-правовой системе "Эділет").

3. Департаменту монетарных операций (Молдабекова А.М.) в установленном законодательством Республики Казахстан порядке обеспечить:

1) совместно с Юридическим департаментом (Сарсенова Н.В.) государственную регистрацию настоящего постановления в Министерстве юстиции Республики Казахстан;

2) в течение десяти календарных дней со дня государственной регистрации настоящего постановления его направление на казахском и русском языках в Республиканское государственное предприятие на праве хозяйственного ведения "Республиканский центр правовой информации" для официального опубликования и включения в Эталонный контрольный банк нормативных правовых актов Республики Казахстан;

3) размещение настоящего постановления на официальном интернет-ресурсе Национального Банка Республики Казахстан после его официального опубликования;

4) в течение десяти рабочих дней после государственной регистрации настоящего постановления представление в Юридический департамент сведений об исполнении мероприятий, предусмотренных подпунктами 2), 3) настоящего пункта и пунктом 4 настоящего постановления.

4. Управлению по защите прав потребителей финансовых услуг и внешних коммуникаций (Терентьев А.Л.) обеспечить в течение десяти календарных дней после государственной регистрации настоящего постановления направление его копии на официальное опубликование в периодические печатные издания.

5. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Национального Банка Республики Казахстан Курманова Ж.Б.

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

*Председатель
Национального Банка*

Д. Акишев

Утверждены
постановлением Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 30 июля 2018 года № 167

Правила проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики

Глава 1. Общие положения

1. Настоящие Правила проведения Национальным Банком Республики Казахстан аукционов в рамках реализации денежно-кредитной политики (далее – Правила) разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 30 марта 1995 года "О Национальном Банке Республики Казахстан" и определяют порядок проведения Национальным Банком Республики Казахстан (далее – Национальный Банк) аукционов в рамках реализации государственной денежно-кредитной политики Республики Казахстан (далее – денежно-кредитная политика).

2. В соответствии с целями денежно-кредитной политики для предоставления и изъятия ликвидности Национальный Банк проводит следующие виды аукционов:

- 1) аукцион по покупке ценных бумаг с обратной продажей;
- 2) аукцион по продаже ценных бумаг с обратной покупкой;
- 3) аукцион краткосрочных нот Национального Банка;
- 4) депозитный аукцион.

3. В Правилах используются понятия, предусмотренные Гражданским кодексом Республики Казахстан (Особенная часть) от 1 июля 1999 года, а также следующие понятия:

1) участник аукциона – банк второго уровня, являющийся участником торгов в форме аукциона (далее – аукцион) по покупке ценных бумаг с обратной продажей и аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, являющийся депонентом центрального депозитария;

- 2) аукционная платформа – автоматизированная информационная подсистема, используемая Национальным Банком для проведения аукционов;
- 3) дата исполнения сделки продажи ценных бумаг – день, когда Национальный Банк продает участнику аукциона ценные бумаги;
- 4) дата исполнения сделки покупки ценных бумаг – день, когда Национальный Банк покупает у участника аукциона ценные бумаги;
- 5) первичный агент – участник аукциона краткосрочных нот Национального Банка, к которому относится банк второго уровня, единый накопительный пенсионный фонд, Национальный оператор почты Республики Казахстан, юридическое лицо, заключившее с Национальным Банком договор об оказании брокерских услуг, клиент, активы которого находятся в доверительном управлении у Национального Банка;
- 6) электронная система передачи данных – финансовая автоматизированная система транспорта информации Республиканского государственного предприятия на праве хозяйственного ведения "Казахстанский центр межбанковских расчетов Национального Банка Республики Казахстан" (далее – ФАСТИ) или международная межбанковская система передачи информации и совершения расчетов по операциям с финансовыми инструментами (Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication), шифруемая с помощью системы программно-криптографической защиты;
- 7) депозитная сделка – сделка между Национальным Банком и контрапартнером о приеме депозита (банковского вклада) в рамках депозитного аукциона;
- 8) дисконтированная цена – цена ниже номинальной стоимости с учетом ставки дисконтирования;
- 9) ставка дисконтирования – процентная ставка, используемая для расчета цены и объема выпуска ценных бумаг на аукционе, проводимом Национальным Банком;
- 10) инвестор – клиент первичного агента;
- 11) цена отсечения – цена, на которой заканчивается удовлетворение заявок первичных агентов;
- 12) ставка отсечения – минимальная (для аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей) либо максимальная (для аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, аукциона краткосрочных нот Национального Банка и депозитного аукциона) процентная ставка, на которой заканчивается удовлетворение заявок;
- 13) ставка доходности – параметр заключаемых сделок покупки (продажи) и обратной продажи (покупки) ценных бумаг, используемый для расчета цены обратной продажи (покупки) ценных бумаг (цены второй сделки) и суммы сделки обратной продажи (покупки) ценных бумаг;
- 14) контрапартнер – участник депозитного аукциона, к которому относится банк второго уровня, единый накопительный пенсионный фонд, Национальный оператор почты Республики Казахстан, юридическое лицо, заключившее с Национальным

Банком договор об оказании брокерских услуг, клиент, активы которого находятся в доверительном управлении у Национального Банка;

15) ломбардный список – перечень ценных бумаг, принимаемых к покупке (продаже) на аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей и аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой. Ценные бумаги, включенные в ломбардный список, соответствуют следующим условиям:

выпуск допущен к обращению на торгах фондовой биржи Республики Казахстан (далее – фондовая биржа);

с даты обратной продажи (покупки) Национальным Банком ценных бумаг до их погашения осталось не менее семи рабочих дней;

не прекращено право собственности на ценные бумаги, не наложено ограничение права собственности на ценные бумаги и не обращено взыскание по обязательствам собственника ценных бумаг. Ломбардный список утверждается приказом Председателя Национального Банка на основании рекомендаций консультативно-совещательного органа Национального Банка – Технического комитета по денежно-кредитной политике Национального Банка;

16) средневзвешенная дисконтированная цена – средняя дисконтированная цена, взвешенная к общему объему краткосрочных нот Национального Банка, сложившемуся на аукционе по цене отсечения;

17) средневзвешенная ставка – средняя процентная ставка, взвешенная к общему объему удовлетворенных или частично удовлетворенных заявок участников аукциона (первичных агентов, контрапартнеров), сложившемуся на аукционе по ставке отсечения;

18) процентная ставка – сумма, выраженная в процентном выражении, выплачиваемая участнику аукциона (контрапартнеру);

19) уполномоченное подразделение – подразделение монетарных операций Национального Банка;

20) досрочное погашение краткосрочных нот Национального Банка – полное или частичное изъятие Национальным Банком из обращения краткосрочных нот Национального Банка до истечения срока погашения на вторичном рынке ценных бумаг, предварительно согласованное с первичным агентом по дате, количеству и цене погашения;

21) выкуп краткосрочных нот Национального Банка – покупка Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка на вторичном рынке ценных бумаг с возможностью их дальнейшего обращения до истечения срока погашения, предварительно согласованная с первичным агентом по дате, количеству и цене выкупа краткосрочных нот Национального Банка;

22) заявка на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка – этап эмиссии краткосрочных нот Национального Банка на аукционе, на котором происходит

дополнительное размещение к ранее выпущенным и обращающимся краткосрочным нотам Национального Банка;

23) условия проведения доразмещения краткосрочных нот Национального Банка – условия доразмещения краткосрочных нот Национального Банка, определяемые и объявляемые Национальным Банком в соответствии с целями денежно-кредитной политики и включающие дату доразмещения, срок обращения, дату погашения, объем доразмещения, условия удовлетворения заявок, дату оплаты, форму доразмещения;

24) условия выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка – условия выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка, определяемые и объявляемые Национальным Банком в соответствии с целями денежно-кредитной политики и включающие дату размещения, срок обращения, дату погашения, объем размещения, условия удовлетворения заявок, дату оплаты, форму размещения;

25) система обмена электронными документами eTransfer.kz – специализированная система электронного документооборота между фондовой биржей и ее членами, предусматривающая криптографические средства защиты передаваемых данных и обеспечивающая их гарантированную доставку.

Глава 2. Заключение договоров и соглашения при проведении Национальным Банком аукционов в рамках денежно-кредитной политики

4. При проведении аукционов в рамках денежно-кредитной политики Национальный Банк заключает один из следующих договоров и (или) соглашение:

1) с участником аукциона по покупке (продаже) ценных бумаг с обратной продажей (покупкой) договор присоединения к заключению сделок по покупке (продаже) ценных бумаг с обратной продажей (покупкой) по результатам аукциона (далее – Договор о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона);

2) с первичным агентом договор присоединения к совершению операций с краткосрочными нотами Национального Банка (далее – Договор о совершении операций с краткосрочными нотами);

3) с контрапартнером для участия в депозитном аукционе соглашение о приеме депозитов (банковских вкладов) и об открытии и ведении сберегательного счета (далее – Соглашение о приеме депозитов).

Сноска. Пункт 4 с изменением, внесенным постановлением Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

5. Для заключения Договора о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона и (или) Договора о совершении операций с краткосрочными нотами потенциальный участник аукциона или потенциальный первичный агент, за исключением единого накопительного пенсионного фонда, юридического лица, заключившего с Национальным Банком договор об оказании брокерских услуг, и

клиента, активы которого находятся в доверительном управлении у Национального Банка, представляет в Национальный Банк следующие документы:

1) заявление в произвольной форме с указанием сведения о наличии лицензии на осуществление брокерской и (или) дилерской деятельности на рынке ценных бумаг, выданной Национальным Банком, на бумажном носителе либо в электронном виде по ФАСТИ, подписанное уполномоченным лицом потенциального участника аукциона или потенциального первичного агента;

2) документ центрального депозитария, подтверждающий наличие лицевого счета в центральном депозитарии.

При наличии действующего между Национальным Банком и банком второго уровня Договора о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона допускается заключение Договора о совершении операций с краткосрочными нотами без представления банком второго уровня в Национальный Банк документов, предусмотренных частью первой настоящего пункта.

При наличии действующего между Национальным Банком и банком второго уровня Договора о совершении операций с краткосрочными нотами допускается заключение Договора о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона без представления банком второго уровня в Национальный Банк документов, предусмотренных частью первой настоящего пункта.

6. Национальный Банк рассматривает заявление потенциального участника аукциона или потенциального первичного агента и в срок не более десяти рабочих дней со дня поступления в Национальный Банк документов, предусмотренных частью первой пункта 5 Правил, направляет на бумажном носителе либо в электронном виде по ФАСТИ уведомление о присоединении к Договору о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона и (или) Договору о совершении операций с краткосрочными нотами либо обоснованный отказ с указанием причин.

7. Для заключения Соглашения о приеме депозитов в рамках участия в депозитном аукционе потенциальный контрапартнер, являющийся резидентом Республики Казахстан, представляет в Национальный Банк следующие документы:

1) ходатайство на имя руководства Национального Банка на заключение Соглашения о приеме депозитов;

2) список уполномоченных на совершение сделок по размещению депозитов (банковских вкладов) в рамках депозитного аукциона работников контрапартнера, утвержденный контрапартнером;

3) устав либо его нотариально засвидетельствованную копию, а в случае если контрапартнер осуществляет свою деятельность на основании типового устава – документ, подтверждающий факт осуществления деятельности на основании типового устава;

4) нотариально удостоверенный документ с образцами подписей работников контрапартнера, уполномоченных на подписание паспорта сделки.

Для заключения Соглашения о приеме депозитов в рамках участия в депозитном аукционе потенциальный контрапартнер, являющийся нерезидентом Республики Казахстан, представляет в Национальный Банк следующие документы:

1) ходатайство на имя руководства Национального Банка на заключение Соглашения о приеме депозитов;

2) нотариально удостоверенную копию учредительных документов (за исключением национальных (центральных) банков иностранных государств);

3) нотариально засвидетельствованную копию лицензии на проведение банковских операций, выданной уполномоченным органом страны нерезидента (за исключением национальных (центральных) банков иностранных государств);

4) копию (копии) документа (документов), удостоверяющего (удостоверяющих) личность лица (лиц), уполномоченного (уполномоченных) подписывать платежные документы при совершении операций, в соответствии с документом с образцами подписей;

5) при наличии, копию документа, подтверждающего регистрацию нерезидента Республики Казахстан в качестве налогоплательщика в Республике Казахстан;

6) консолидированную финансовую отчетность за последние три года.

В случае наличия у контрапартнера Договора присоединения к заключению сделок с финансовыми инструментами, заключенного между Национальным Банком и контрапартнером, допускается заключение Соглашения о приеме депозитов без повторного представления в Национальный Банк контрапартнером документов, предусмотренных настоящим пунктом.

Сноска. Пункт 7 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

7-1. Национальный Банк рассматривает документы, представленные потенциальным контрапартнером в соответствии с пунктом 7 Правил, и в случае соответствия представленных документов пункту 7 Правил в срок не более десяти рабочих дней со дня их поступления в Национальный Банк, письменно сообщает о готовности заключить Соглашение о приеме депозитов или направляет отказ с указанием причин.

Сноска. Правила дополнены пунктом 7-1 в соответствии с приказом Министра труда и социальной защиты населения РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

Глава 3. Проведение аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей

8. К участию в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей допускается участник аукциона, соответствующий следующим требованиям:

1) отсутствие нарушений нормативов минимальных резервных требований два и более раза в течение трех последовательных календарных месяцев, предшествующих дате участия в аукционе. Указанное требование действует до даты оплаты участником аукциона административного штрафа за административное правонарушение, предусмотренное частью пятой статьи 213 Кодекса Республики Казахстан об административных правонарушениях от 5 июля 2014 года (далее – Кодекс об административных правонарушениях);

2) отсутствие нарушений пруденциальных нормативов на последнюю отчетную дату;

3) наличие в договоре корреспондентского счета, заключенного с Национальным Банком, условия, предусматривающего право Национального Банка на изъятие денег с корреспондентского счета участника аукциона без его согласия в случае неисполнения им обязательств перед Национальным Банком;

4) наличие действующего Договора о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона;

5) отсутствие задолженности по оплате основного долга и (или) вознаграждения по займам, предоставленным Национальным Банком.

9. В случае несоответствия участника аукциона одному или нескольким требованиям, предусмотренным пунктом 8 Правил, Национальный Банк отказывает участнику аукциона в участии в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей.

10. Объектом аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей является ставка доходности, определяющая цену обратной продажи ценной бумаги по формуле для расчета цены обратной продажи ценной бумаги согласно приложению 1 к Правилам.

11. Соответствие участника аукциона требованиям, предусмотренным пунктом 8 Правил, определяется уполномоченным подразделением на основании информации, представленной:

1) подразделением статистики финансового рынка Национального Банка – по подпункту 1) пункта 8 Правил;

2) уполномоченным органом по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций – по подпункту 2) пункта 8 Правил;

3) подразделением операционного учета Национального Банка – по подпункту 3) пункта 8 Правил.

Сноска. Пункт 11 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

12. Аукциону по покупке ценных бумаг с обратной продажей присваивается уникальный идентификационный номер с указанием кода валюты, даты проведения

аукциона и срока предоставления ликвидности (далее – номер аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей).

13. Информация, связанная с проведением аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, передаваемая Национальным Банком участникам аукциона через электронную систему передачи данных, содержит следующие сведения:

- 1) номер аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей;
- 2) ломбардный список;
- 3) цену покупки (цену первой сделки) ценных бумаг, включенных в ломбардный список. Цена покупки (цена первой сделки) определяется как чистая стоимость (без учета начисленного вознаграждения) одной единицы ценной бумаги с четырьмя знаками после запятой;
- 4) срок предоставления ликвидности (разница в календарных днях между датами исполнения сделки покупки (первой сделки) ценных бумаг и сделки обратной продажи (второй сделки) ценных бумаг;
- 5) объявленный объем размещаемой ликвидности;
- 6) минимальную ставку доходности (минимально допустимый размер ставки доходности, запрашиваемой участником аукциона).

14. В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы электронной системы передачи данных) передачи участникам аукциона Национальным Банком информации, связанной с проведением аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, через электронную систему передачи данных, допускается передача информации, связанной с проведением аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, на бумажном носителе.

15. Не позднее, чем за один рабочий день до дня проведения аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, Национальный Банк направляет участникам аукциона и центральному депозитарию ломбардный список и информацию, связанную с проведением аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей.

16. Рыночная стоимость ценных бумаг, включенных в ломбардный список в рамках аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, рассчитывается в соответствии с дисконтом, определенным фондовой биржей.

17. Цена покупки ценной бумаги определяется как чистая стоимость (без учета начисленного вознаграждения) одной единицы ценной бумаги с четырьмя знаками после запятой.

18. В день проведения аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей с 09.00 до 11.30 часов времени города Нур-Султан участник аукциона подает в уполномоченное подразделение заявку на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) подачи заявки на участие в аукционе по покупке ценных

бумаг с обратной продажей в электронном виде через аукционную платформу допускается подача участником аукциона заявки на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей по форме согласно приложению 2 к Правилам на бумажном носителе.

Сноска. Пункт 18 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

19. Участник аукциона подает заявку на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями.

20. Минимальный объем одной заявки с конкурентным или неконкурентным предложением составляет не менее 50 000 000 (пятидесяти миллионов) тенге.

21. Аукцион по покупке ценных бумаг с обратной продажей проводится Национальным Банком при наличии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных участников аукциона.

22. В заявках с конкурентными предложениями участников аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей указываются выпуск ценной бумаги, номинальная стоимость и процентная ставка.

23. В заявках с неконкурентными предложениями участников аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей указываются выпуск ценной бумаги и номинальная стоимость.

24. Заявки с конкурентными предложениями участников аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей упорядочиваются и удовлетворяются по уровню предложенной участником аукциона процентной ставки, начиная с максимальной, но не ниже ставки отсечения.

25. Заявки с неконкурентными предложениями участников аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей удовлетворяются по средневзвешенной ставке, сложившейся по итогам проведения аукциона.

26. Уполномоченное подразделение к 12.00 часам времени города Нур-Султан обобщает заявки на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей в сводную ведомость поступивших заявок на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей по форме согласно приложению 3 к Правилам.

Сноска. Пункт 26 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

27. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, с 12.00 до 13.00 часов времени города Нур-Султан на основании полученных данных об аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей принимает решение о ставке отсечения, объеме удовлетворения заявок, после

чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей по форме согласно приложению 3 к Правилам.

Сноска. Пункт 27 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

28. Уполномоченное подразделение на основании информации о ставке отсечения и объеме удовлетворенных заявок заключает сделки покупки и обратной продажи ценных бумаг и по завершении аукциона выдает участнику аукциона уведомление об удовлетворенном объеме заявок по аукциону по покупке ценных бумаг с обратной продажей по форме согласно приложению 4 к Правилам на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

29. По итогам аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей между Национальным Банком и участником аукциона заключаются следующие парные сделки:

1) по покупке Национальным Банком ценных бумаг (сделка покупки (первая сделка));

2) по обратной продаже Национальным Банком тех же ценных бумаг в определенный срок после сделки покупки (сделка обратной продажи (вторая сделка)).

30. Национальный Банк в соответствии с направлениями денежно-кредитной политики и конъюнктурой финансового рынка оперативно изменяет условия аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей (увеличивает объявленный объем размещения ценных бумаг, уменьшает объявленный объем размещения ценных бумаг, отменяет аукцион по покупке ценных бумаг с обратной продажей).

31. Национальный Банк в случае получения результатов аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, недостаточных для выполнения задач денежно-кредитной политики, а также при отсутствии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных участников аукциона объявляет аукцион по покупке ценных бумаг с обратной продажей несостоявшимся.

32. Объявление об аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей несостоявшимся утверждается распоряжением руководителя уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лица, его замещающего.

33. Уполномоченное подразделение не позднее 18.30 часов времени города Нур-Султан в день проведения аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей размещает на официальном интернет-ресурсе Национального Банка информацию об итогах состоявшегося аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей.

Сноска. Пункт 33 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

34. Расчеты по сделкам покупки и обратной продажи ценных бумаг по итогам аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей осуществляются в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

35. В целях упрощения учета ценных бумаг расчеты по ценным бумагам осуществляются по ценам без учета накопленного вознаграждения. Вознаграждение по ценным бумагам получает участник аукциона, продавший ценные бумаги.

36. Обмен приказами между центральным депозитарием, участником аукциона и Национальным Банком осуществляется в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

37. В случае неисполнения участником аукциона обязательств по сделкам, заключенным по итогам аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, на условиях, установленных в день заключения сделки обратной продажи ценных бумаг, Национальный Банк в рабочий день, следующий за днем неисполнения обязательств участником аукциона, направляет в центральный депозитарий приказ на списание ценных бумаг со счета участника аукциона и зачисление ценных бумаг на счет Национального Банка в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

Сумма накопленного купонного вознаграждения по ценной бумаге, начисленного до даты неисполнения участником аукциона обязательств по сделкам, заключенным по итогам аукциона по покупке ценных бумаг с обратной продажей, переводится в пользу участника аукциона.

38. Учет и регистрация операций покупки ценных бумаг и обратной продажи ценных бумаг Национальным Банком осуществляется центральным депозитарием на соответствующем субсчете Национального Банка в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

39. В случае если дата проведения сделки обратной продажи ценных бумаг выпадает на нерабочий (праздничный или выходной) день, исполнение сделки обратной продажи ценных бумаг осуществляется в первый рабочий день, следующий за датой обратной продажи ценных бумаг в соответствии с условиями сделки.

Глава 4. Проведение аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой

40. К участию в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой допускается участник аукциона, соответствующий следующим требованиям:

1) отсутствие нарушений нормативов минимальных резервных требований два и более раза в течение трех последовательных календарных месяцев, предшествующих дате участия в аукционе. Указанное требование действует до даты оплаты участником аукциона административного штрафа за административное правонарушение,

предусмотренное частью пятой статьи 213 Кодекса об административных правонарушениях;

2) отсутствие нарушений пруденциальных нормативов на последнюю отчетную дату;

3) наличие в договоре корреспондентского счета, заключенного с Национальным Банком, условия, предусматривающего право Национального Банка на изъятие денег с корреспондентского счета участника аукциона без его согласия в случае неисполнения им обязательств перед Национальным Банком;

4) наличие действующего Договора о заключении сделок с ценными бумагами в рамках аукциона;

5) отсутствие задолженности по оплате основного долга и (или) вознаграждения по займам, предоставленным Национальным Банком.

41. В случае несоответствия участника аукциона одному или нескольким требованиям, предусмотренным пунктом 40 Правил, Национальный Банк отказывает участнику аукциона в участии в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой.

42. Объектом аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой является ставка доходности, определяющая цену сделки обратной покупки ценной бумаги по формуле для расчета цены обратной покупки ценной бумаги согласно приложению 5 к Правилам.

43. Соответствие участника аукциона требованиям, предусмотренным пунктом 40 Правил, определяется уполномоченным подразделением на основании информации, представленной:

1) подразделением статистики финансового рынка Национального Банка – по подпункту 1) пункта 40 Правил;

2) уполномоченным органом по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций – по подпункту 2) пункта 40 Правил;

3) подразделением операционного учета Национального Банка – по подпункту 3) пункта 40 Правил.

Сноска. Пункт 43 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

44. Аукциону по продаже ценных бумаг с обратной покупкой присваивается уникальный идентификационный номер с указанием кода валюты, даты проведения аукциона и срока изъятия ликвидности (далее – номер аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой).

45. Информация, связанная с проведением аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, передаваемая Национальным Банком участникам аукциона через электронную систему передачи данных, содержит следующие сведения:

1) номер аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой;

2) срок изъятия ликвидности (разница в календарных днях между датами исполнения сделки продажи (первой сделки) ценных бумаг и сделки обратной покупки (второй сделки) ценных бумаг);

3) объявленный объем изымаемой ликвидности;

4) максимальную ставку доходности (максимально допустимый размер ставки доходности, запрашиваемой участником аукциона);

5) вид залога.

46. В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы электронной системы передачи данных) передачи участникам аукциона Национальным Банком информации, связанной с проведением аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, через электронную систему передачи данных допускается передача информации, связанной с проведением аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, на бумажном носителе.

47. Не позднее, чем за один рабочий день до дня проведения аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, Национальный Банк направляет участникам аукциона и центральному депозитарию информацию, связанную с проведением аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой.

48. Рыночная стоимость ценных бумаг, предоставляемых Национальным Банком в качестве залога в рамках аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, рассчитывается в соответствии с дисконтом, определенным фондовой биржей.

49. Цена продажи ценной бумаги определяется как чистая стоимость (без учета начисленного вознаграждения) одной единицы ценной бумаги с четырьмя знаками после запятой.

50. В день проведения аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой с 9.00 до 11.30 часов времени города Нур-Султан участник аукциона подает в уполномоченное подразделение заявку на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) подачи заявки на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой в электронном виде через аукционную платформу допускается подача участником аукциона заявки на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой по форме согласно приложению 6 к Правилам на бумажном носителе.

Сноска. Пункт 50 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

51. Участник аукциона подает заявку на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями.

52. Минимальный объем одной заявки с конкурентным или неконкурентным предложением составляет не менее 50 000 000 (пятидесяти миллионов) тенге.

53. Аукцион по продаже ценных бумаг с обратной покупкой проводится Национальным Банком при наличии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных участников аукциона.

54. В заявках с конкурентными предложениями участников аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой указываются выпуск ценной бумаги, номинальная стоимость и процентная ставка.

55. В заявках с неконкурентными предложениями участников аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой указываются выпуск ценной бумаги и номинальная стоимость.

56. Заявки с конкурентными предложениями участников аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой упорядочиваются и удовлетворяются по уровню предложенной участником аукциона процентной ставки, начиная с минимальной, но не выше ставки отсечения.

57. Заявки с неконкурентными предложениями участников аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой удовлетворяются по средневзвешенной ставке, сложившейся по итогам проведения аукциона.

58. Уполномоченное подразделение к 12.00 часам времени города Нур-Султан обобщает заявки на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой в сводную ведомость поступивших заявок на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой по форме согласно приложению 7 к Правилам.

Сноска. Пункт 58 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

59. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, с 12.00 до 13.00 часов времени города Нур-Султан на основании полученных данных об аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой принимает решение о ставке отсечения, объеме удовлетворения заявок, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой по форме согласно приложению 7 к Правилам.

Сноска. Пункт 59 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

60. Уполномоченное подразделение на основании информации о ставке отсечения и объеме удовлетворенных заявок заключает сделки продажи и обратной покупки ценных бумаг и по завершении аукциона выдает участнику аукциона уведомление об удовлетворенном объеме заявок по аукциону по продаже ценных бумаг с обратной

покупкой по форме согласно приложению 8 к Правилам на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

61. По итогам аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой между Национальным Банком и участником аукциона заключаются следующие парные сделки:

1) по продаже Национальным Банком ценных бумаг (сделка продажи (первая сделка));

2) по обратной покупке Национальным Банком тех же ценных бумаг в определенный срок после сделки продажи (сделка обратной покупки (вторая сделка)).

62. Национальный Банк в соответствии с направлениями денежно-кредитной политики и конъюнктурой финансового рынка оперативно изменяет условия аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой (увеличивает объявленный объем изымаемой ликвидности, уменьшает объявленный объем изымаемой ликвидности, отменяет аукцион по продаже ценных бумаг с обратной покупкой).

63. Национальный Банк в случае получения результатов аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, недостаточных для выполнения задач денежно-кредитной политики, а также при отсутствии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных участников аукциона объявляет аукцион по продаже ценных бумаг с обратной покупкой несостоявшимся.

64. Объявление об аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой несостоявшимся утверждается распоряжением руководителя уполномоченного подразделения либо в случае его отсутствия, лица, его замещающего.

65. Уполномоченное подразделение не позднее 18.30 часов времени города Нур-Султан в день проведения аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой размещает на официальном интернет-ресурсе Национального Банка информацию об итогах состоявшегося аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой.

Сноска. Пункт 65 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

66. Расчеты по сделкам продажи и обратной покупки ценных бумаг по итогам аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой осуществляются в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

67. В целях упрощения учета ценных бумаг расчеты по ценным бумагам осуществляются по ценам без учета накопленного вознаграждения. Вознаграждение по ценным бумагам получает Национальный Банк.

68. Обмен приказами между центральным депозитарием, участником аукциона и Национальным Банком осуществляется в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

69. В случае неисполнения участником аукциона обязательств по сделкам, заключенным по итогам аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, на условиях, установленных в день заключения сделки обратной покупки ценных бумаг, Национальный Банк в рабочий день, следующий за днем неисполнения обязательств участником аукциона, направляет в центральный депозитарий приказ на списание ценных бумаг со счета участника аукциона и зачисление ценных бумаг на счет Национального Банка в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

Сумма накопленного купонного вознаграждения по ценной бумаге, начисленного до даты неисполнения обязательств участником аукциона по сделкам, заключенным по итогам аукциона по продаже ценных бумаг с обратной покупкой, переводится в пользу Национального Банка.

70. Учет и регистрация операций продажи ценных бумаг и обратной покупки Национальным Банком осуществляется центральным депозитарием на соответствующем субсчете Национального Банка в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

71. В случае если дата проведения сделки обратной покупки ценных бумаг выпадает на нерабочий (праздничный или выходной) день, исполнение сделки обратной покупки ценных бумаг осуществляется в первый рабочий день, следующий за датой обратной покупки ценных бумаг в соответствии с условиями сделки.

Глава 5. Проведение аукциона краткосрочных нот Национального Банка

72. Краткосрочные ноты Национального Банка представляют собой инструмент денежно-кредитной политики, предназначенный для регулирования ставок вознаграждения на финансовом рынке.

73. Краткосрочные ноты Национального Банка размещаются Национальным Банком по дисконтированной цене, а погашаются по номинальной стоимости, за исключением случаев их досрочного погашения.

74. Номинальная стоимость краткосрочной ноты Национального Банка составляет 100 (сто) тенге.

75. Центральный депозитарий присваивает международный идентификационный номер (код ISIN) каждому выпуску краткосрочных нот Национального Банка.

Сноска. Пункт 75 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

76. Аукцион краткосрочных нот Национального Банка осуществляется через первичных агентов на основании Договора о совершении операций с краткосрочными нотами и в соответствии с условиями выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка.

77. Ставка вознаграждения по краткосрочным нотам Национального Банка выражается в процентах и рассчитывается по формуле для расчета ставки

вознаграждения по краткосрочным нотам Национального Банка согласно приложению 9 к Правилам.

78. Аукцион краткосрочных нот Национального Банка осуществляется Национальным Банком в следующих формах:

1) электронный аукцион краткосрочных нот Национального Банка (далее – электронный аукцион);

2) аукцион по продаже краткосрочных нот Национального Банка по дисконтированным ценам, согласованным с первичным агентом (далее – аукцион по продаже);

3) аукцион в форме подписки по цене, установленной Национальным Банком (далее – аукцион в форме подписки).

79. Информация, связанная с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка, передаваемая Национальным Банком первичным агентам через электронную систему передачи данных, содержит следующие сведения:

1) дату проведения аукциона;

2) национальный идентификационный номер и (или) международный идентификационный номер выпуска краткосрочных нот Национального Банка;

3) дату валютирования;

4) срок обращения краткосрочных нот Национального Банка;

5) дату погашения краткосрочных нот Национального Банка.

80. В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы электронной системы передачи данных) передачи первичным агентам Национальным Банком информации, связанной с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка, через электронную систему передачи данных допускается передача информации, связанной с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка, на бумажном носителе.

81. Не позднее, чем за один рабочий день до дня проведения электронного аукциона, Национальный Банк направляет первичным агентам информацию, связанную с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка.

82. В день проведения электронного аукциона, исходя из основных направлений денежно-кредитной политики и конъюнктуры финансового рынка, допускается изменение Национальным Банком условий выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка в части:

1) приобретения краткосрочных нот Национального Банка первичными агентами или инвесторами;

2) участия в электронном аукционе нерезидентов Республики Казахстан;

3) удовлетворения заявок с неконкурентными предложениями;

4) объема размещения краткосрочных нот Национального Банка.

83. В день проведения электронного аукциона с 9.00 до 11.30 часов времени города Нур-Султан первичный агент подает в уполномоченное подразделение заявку на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) подачи заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу допускается подача первичным агентом заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка по форме согласно приложению 10 к Правилам на бумажном носителе.

Сноска. Пункт 83 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

84. Для участия в электронном аукционе первичный агент подает заявку на покупку краткосрочных нот Национального Банка с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями.

85. В заявках с конкурентными предложениями первичных агентов в рамках электронного аукциона указываются количество краткосрочных нот Национального Банка, предполагаемая дисконтированная цена одной краткосрочной ноты Национального Банка, общий объем покупки краткосрочных нот Национального Банка по номинальной стоимости и дисконтированной цене.

86. В заявках с неконкурентными предложениями первичных агентов в рамках электронного аукциона указывается общее количество краткосрочных нот Национального Банка, которое первичный агент готов приобрести по средневзвешенной дисконтированной цене, сложившейся на электронном аукционе.

87. Уполномоченное подразделение в рамках электронного аукциона к 11.30 часам времени города Нур-Султан обобщает заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов в сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

Сноска. Пункт 87 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

88. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, с 11.30 до 13.00 часов времени города Нур-Султан на основании полученных данных об электронном аукционе принимает решение о ценовых условиях, объеме удовлетворения заявок и (или) доразмещении краткосрочных нот Национального Банка, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

Сноска. Пункт 88 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

89. Заявки с конкурентными предложениями первичных агентов в рамках электронного аукциона упорядочиваются и удовлетворяются в пределах условий выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка.

90. Заявки с неконкурентными предложениями первичных агентов в рамках электронного аукциона удовлетворяются по средневзвешенной ставке, сложившейся по итогам проведения электронного аукциона, в первую очередь.

91. Уполномоченное подразделение на основании информации о ценовых условиях и объеме удовлетворенных заявок и (или) доразмещении краткосрочных нот Национального Банка осуществляет размещение или доразмещение краткосрочных нот Национального Банка и уведомляет первичного агента об удовлетворенном объеме заявок на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

92. В случае принятия решения о доразмещении краткосрочных нот Национального Банка уполномоченное подразделение в день проведения электронного аукциона до 13.30 часов времени города Нур-Султан направляет первичным агентам условия проведения доразмещения краткосрочных нот Национального Банка в порядке, предусмотренном пунктами 79 и 80 Правил.

Сноска. Пункт 92 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

93. Заявки на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов принимаются уполномоченным подразделением до времени, указанного в условиях проведения доразмещения краткосрочных нот Национального Банка.

94. Доразмещение краткосрочных нот Национального Банка осуществляется уполномоченным подразделением по средневзвешенной дисконтированной цене, сложившейся на электронном аукционе.

95. Уполномоченное подразделение до времени, указанного в условиях проведения доразмещения краткосрочных нот Национального Банка, обобщает заявки на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов в сводную ведомость поступивших заявок на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка.

96. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, на основании полученных данных о доразмещении краткосрочных нот Национального Банка принимает решение об объеме удовлетворения заявок, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка.

97. Заявки на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка упорядочиваются и удовлетворяются в порядке очередности с учетом их фактического поступления в Национальный Банк.

98. Уполномоченное подразделение на основании информации об объеме удовлетворенных заявок на доразмещение краткосрочных нот Национального Банка осуществляет доразмещение краткосрочных нот Национального Банка и не позднее 17.00 времени города Нур-Султан дня проведения доразмещения краткосрочных нот Национального Банка уведомляет первичного агента об удовлетворенном объеме заявок на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

Сноска. Пункт 98 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

99. В день проведения аукциона по продаже уполномоченное подразделение до 13.00 времени города Нур-Султан направляет первичным агентам информацию, связанную с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка, после согласования с первичными агентами дисконтированных цен и объявленного объема размещения краткосрочных нот Национального Банка в пределах дисконтированных цен, определенных руководителем уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицом, его замещающим.

Сноска. Пункт 99 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

100. В день проведения аукциона по продаже первичный агент подает в уполномоченное подразделение заявку на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) подачи заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу допускается подача первичным агентом заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка по форме согласно приложению 10 к Правилам на бумажном носителе.

101. Заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов в рамках аукциона по продаже принимаются уполномоченным подразделением до времени, указанного в условиях выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка.

102. Уполномоченное подразделение в рамках аукциона по продаже до времени, указанного в условиях выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка, обобщает заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов в сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

103. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, на основании полученных данных об аукционе по продаже принимает решение об объеме размещения краткосрочных нот Национального Банка в пределах дисконтированных цен, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

104. Уполномоченное подразделение в рамках аукциона по продаже на основании информации об объеме размещения краткосрочных нот Национального Банка в пределах дисконтированных цен осуществляет размещение краткосрочных нот Национального Банка и не позднее 17.00 часов города Нур-Султан дня проведения аукциона по продаже уведомляет первичного агента об удовлетворенном объеме краткосрочных нот Национального Банка на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

Сноска. Пункт 104 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

105. В день проведения аукциона в форме подписки уполномоченное подразделение до 12.00 времени города Нур-Султан направляет первичным агентам информацию, связанную с проведением аукциона краткосрочных нот Национального Банка, а также дисконтированную цену, определенную руководителем уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицом, его замещающим.

Сноска. Пункт 105 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

106. В день проведения аукциона в форме подписки первичный агент подает в уполномоченное подразделение заявку на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) подачи заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка в электронном виде через аукционную платформу допускается подача первичным агентом заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка по форме согласно приложению 10 к Правилам на бумажном носителе.

107. Заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка первичных агентов в рамках аукциона в форме подписки принимаются уполномоченным подразделением до времени, указанного в условиях выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка.

108. Уполномоченное подразделение в рамках аукциона в форме подписки до времени, указанного в условиях выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка, обобщает заявки на покупку краткосрочных нот Национального

Банка первичных агентов в сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

109. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, на основании полученных данных об аукционе в форме подписки, принимает решение об объеме размещения краткосрочных нот Национального Банка, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка.

110. Заявки на покупку краткосрочных нот Национального Банка аукциона в форме подписки упорядочиваются и удовлетворяются в порядке очередности с учетом их фактического поступления в Национальный Банк.

111. Уполномоченное подразделение в рамках аукциона в форме подписки на основании информации об объеме размещения краткосрочных нот Национального Банка осуществляет размещение краткосрочных нот Национального Банка и не позднее 17.00 часов города Нур-Султан дня проведения аукциона в форме подписки уведомляет первичного агента об удовлетворенном объеме заявок на покупку краткосрочных нот Национального Банка на бумажном носителе либо в электронном виде через аукционную платформу.

Сноска. Пункт 111 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

112. Итоговый объем размещения краткосрочных нот Национального Банка соответствующего выпуска утверждается распоряжением руководителя уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лица, его замещающего

113. Национальный Банк в случае получения результатов аукциона краткосрочных нот Национального Банка, недостаточных для выполнения задач денежно-кредитной политики, на основании полученных данных от уполномоченного подразделения объявляет аукцион краткосрочных нот Национального Банка несостоявшимся.

114. Объявление об аукционе краткосрочных нот Национального Банка несостоявшимся утверждается распоряжением руководителя уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лица, его замещающего.

115. Уполномоченное подразделение не позднее 18.30 часов времени города Нур-Султан в день проведения аукциона краткосрочных нот Национального Банка размещает на официальном интернет-ресурсе Национального Банка информацию об итогах состоявшегося аукциона краткосрочных нот Национального Банка.

Сноска. Пункт 115 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

116. Уполномоченное подразделение и первичный агент не позднее 17.00 часов времени города Нур-Султан дня оплаты, установленного условиями выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка, передают в центральный депозитарий приказы в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

Сноска. Пункт 116 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

117. В случае получения первичным агентом и Национальным Банком уведомления о неисполнении приказа первичный агент и Национальный Банк повторно передают в центральный депозитарий приказ, устранив причины, повлекшие неисполнение приказа.

118. Обращение краткосрочных нот Национального Банка начинается со дня оплаты, установленного Национальным Банком, в соответствии с условиями выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка.

119. Обращение краткосрочных нот Национального Банка завершается за один рабочий день до даты погашения краткосрочных нот Национального Банка.

120. Учет краткосрочных нот Национального Банка и прав по ним осуществляется по лицевому счету первичного агента и на индивидуальных субсчетах инвесторов, открытых на лицевых счетах первичных агентов.

121. Не позднее 16.00 часов времени города Нур-Султан рабочего дня, предшествующего дню погашения краткосрочных нот Национального Банка, центральный депозитарий формирует список держателей краткосрочных нот Национального Банка, имеющих право на получение денег от погашения краткосрочных нот Национального Банка.

Сноска. Пункт 121 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

122. В день погашения краткосрочных нот Национального Банка Национальный Банк до 11.00 часов времени города Нур-Султан осуществляет перевод денег на позицию центрального депозитария в соответствии со сведениями о предстоящем погашении краткосрочных нот Национального Банка с указанием количества краткосрочных нот Национального Банка, суммы, подлежащей выплате при погашении краткосрочных нот Национального Банка, и реквизитов центрального депозитария.

Сноска. Пункт 122 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

123. Перевод денег на позицию первичного агента в погашение краткосрочных нот Национального Банка осуществляется центральным депозитарием по их номинальной стоимости в день погашения до 12.00 часов времени города Нур-Султан.

Сноска. Пункт 123 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

124. После перевода первичному агенту денег в погашение краткосрочных нот Национального Банка центральным депозитарием осуществляется списание (погашение) краткосрочных нот Национального Банка с лицевого счета первичного агента.

125. В целях реализации денежно-кредитной политики допускается досрочное погашение Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка путем их выкупа на организованном или неорганизованном рынке ценных бумаг.

126. Для досрочного погашения краткосрочных нот Национального Банка и учета выкупленных краткосрочных нот Национального Банка Национальный Банк открывает в системе учета центрального депозитария на свое имя в рамках лицевого счета субсчет эмитента для учета выкупленных ценных бумаг.

127. Выкуп Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка осуществляется на организованном и неорганизованном рынках ценных бумаг путем заключения сделки купли-продажи краткосрочных нот Национального Банка.

128. Выкуп Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка на организованном рынке ценных бумаг осуществляется через торговую систему фондовой биржи и оформляется первичными документами, формируемыми фондовой биржей и (или) системой обмена электронными документами eTransfer.kz, которые являются документами, удостоверяющими факт совершения сделки.

129. Первичные документы, формируемые фондовой биржей и (или) системой обмена электронными документами eTransfer.kz, содержат следующие сведения:

- 1) национальный идентификационный номер и (или) международный идентификационный номер выпуска краткосрочных нот Национального Банка;
- 2) дату выпуска и погашения краткосрочных нот Национального Банка;
- 3) количество краткосрочных нот Национального Банка;
- 4) стоимость одной краткосрочной ноты Национального Банка;
- 5) объем сделки (общая сумма в тенге);
- 6) доходность к погашению краткосрочных нот Национального Банка (выраженная в процентах);
- 7) дату сделки и (или) дату оплаты краткосрочных нот Национального Банка.

130. Регистрация выкупа краткосрочных нот Национального Банка на организованном рынке ценных бумаг осуществляется центральным депозитарием на основании приказа фондовой биржи о выкупе краткосрочных нот Национального Банка.

131. Регистрация сделки купли-продажи краткосрочных нот Национального Банка на неорганизованном рынке ценных бумаг осуществляется центральным депозитарием

на основании встречных приказов о покупке (продаже) краткосрочных нот Национального Банка уполномоченного подразделения и первичного агента.

132. Допускается дальнейшее обращение выкупленных Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка до истечения срока их обращения без погашения.

133. Выкупленные Национальным Банком краткосрочные ноты Национального Банка на основании информации уполномоченного подразделения погашаются полностью или частично до истечения срока обращения краткосрочных нот Национального Банка.

134. Решение о досрочном погашении Национальным Банком краткосрочных нот Национального Банка оформляется распоряжением руководителя уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лица, его замещающего.

135. Регистрация досрочного погашения краткосрочных нот Национального Банка осуществляется центральным депозитарием в соответствии со сводом правил центрального депозитария.

Глава 6. Проведение депозитного аукциона

136. Депозитный аукцион представляет собой инструмент денежно-кредитной политики, предназначенный для изъятия краткосрочной ликвидности на финансовом рынке, при котором Национальный Банк заимствует у контрапартнеров деньги путем заключения депозитных сделок.

137. Объектом депозитного аукциона является процентная ставка.

Сумма вознаграждения по депозитному аукциону начисляется по простому методу начисления (начисление вознаграждения осуществляется с первого дня привлечения депозита), за расчетную базу условно принимается фактическое количество дней нахождения денег на депозите (банковском вкладе) и 360 (триста шестьдесят) дней в году.

Сноска. Пункт 137 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 31.12.2019 № 270 (вводится в действие с 01.01.2020).

138. Информация, связанная с проведением депозитного аукциона, передается Национальным Банком контрапартнерам через аукционную платформу и содержит следующие сведения:

- 1) дату проведения аукциона;
- 2) дату расчетов по результатам аукциона;
- 3) объявленный объем депозитного аукциона;
- 4) способ размещения (одноценовой или многоценовой);
- 5) срок сделки.

Сноска. Пункт 138 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после

дня его первого официального опубликования).

139. Исключен постановлением Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

140. В день проведения депозитного аукциона с 9.00 до 11.30 времени города Нур-Султан контрапартнер подает заявку на участие в депозитном аукционе в электронном виде через аукционную платформу.

В случае невозможности по техническим причинам (в случае сбоя работы аукционной платформы) приема заявок на участие в депозитном аукционе в электронном виде через аукционную платформу уполномоченное подразделение продлевает время приема заявок на участие в депозитном аукционе через аукционную платформу.

Сноска. Пункт 140 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

141. Контрапартнер подает заявку на участие в депозитном аукционе с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями.

142. Минимальный объем одной заявки с конкурентным или неконкурентным предложением составляет 10 000 000 (десять миллионов) тенге.

143. Депозитный аукцион проводится Национальным Банком при наличии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных контрапартнеров.

144. В заявках с конкурентными предложениями указывается размещаемый объем денег и процентная ставка.

145. В заявках с неконкурентными предложениями указывается размещаемый объем денег.

146. В день проведения депозитного аукциона Национальный Банк в соответствии с направлениями денежно-кредитной политики и конъюнктурой финансового рынка оперативно изменяет условия депозитного аукциона (увеличение объявленного объема депозитного аукциона, уменьшение объявленного объема депозитного аукциона, отмена депозитного аукциона, изменение доли удовлетворения заявок с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями, способа удовлетворения заявок (одноценовой или многоценовой способ)).

147. Уполномоченное подразделение после закрытия приема заявок на участие в депозитном аукционе обобщает заявки на участие в депозитном аукционе в сводную ведомость поступивших заявок на участие в депозитном аукционе.

Сноска. Пункт 147 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

148. Руководитель уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицо, его замещающее, с 11.30 до 13.00 часов времени города Нур-Султан на основании полученных данных о депозитном аукционе принимает решение о ставке отсеечения, объеме удовлетворения заявок либо о признании депозитного аукциона несостоявшимся, после чего подписывает сводную ведомость поступивших заявок на участие в депозитном аукционе.

Сноска. Пункт 148 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

149. Заявки с конкурентными и (или) неконкурентными предложениями контрапартнеров упорядочиваются и удовлетворяются в соответствии с выбранным способом удовлетворения заявок и решением, принятым руководителем уполномоченного подразделения либо, в случае его отсутствия, лицом, его замещающим.

150. При одноценовом способе удовлетворения заявок на участие в депозитном аукционе конкурентные и (или) неконкурентные заявки контрапартнеров удовлетворяются или частично удовлетворяются по ставке отсеечения.

151. При многоценовом способе удовлетворения заявок с конкурентными предложениями контрапартнеров в рамках депозитного аукциона удовлетворение или частичное удовлетворение заявок осуществляется по уровню предложенной контрапартнером процентной ставки.

152. При многоценовом способе удовлетворения заявок с неконкурентными предложениями контрапартнеров в рамках депозитного аукциона удовлетворение или частичное удовлетворение заявок осуществляется по средневзвешенной ставке.

153. Уполномоченное подразделение на основании информации о ставке отсеечения и объеме удовлетворенных заявок, уведомляет контрапартнера об удовлетворенном объеме заявок в электронном виде через аукционную платформу.

По результатам депозитного аукциона с контрапартнерами заключаются депозитные сделки с оформлением паспортов сделок (трейд-тикеты).

Сноска. Пункт 153 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

154. Паспорт сделки (трейд-тикет) содержит следующие сведения о сделке:

- 1) дату открытия и завершения сделки;
- 2) срок сделки в календарных днях;
- 3) сумму сделки;
- 4) ставку вознаграждения (выраженную в процентах годовых);
- 5) сумму вознаграждения;
- 6) реквизиты Национального Банка и контрапартнера.

Сноска. Пункт 154 с изменением, внесенным постановлением Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

155. Контрпартнер, заявка которого удовлетворена Национальным Банком по результатам депозитного аукциона, на дату расчетов по депозитному аукциону перечисляет деньги в пользу Национального Банка.

Сноска. Пункт 155 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

156. В случае если дата закрытия депозитной сделки приходится на нерабочий (праздничный или выходной) день, закрытие депозитной сделки осуществляется в первый рабочий день, следующий за датой закрытия депозитной сделки в соответствии с условиями сделки.

157. Допускается досрочное закрытие контрагентом депозитной сделки, заключенной в рамках депозитного аукциона, без выплаты накопленного вознаграждения.

158. В день закрытия депозитного аукциона Национальный Банк перечисляет основную сумму и сумму вознаграждения по депозитной сделке контрагенту.

159. Национальный Банк в случае получения результатов депозитного аукциона, недостаточных для выполнения задач денежно-кредитной политики, а также при отсутствии двух и более заявок с конкурентными предложениями от не менее двух разных контрагентов объявляет депозитный аукцион несостоявшимся.

160. Уполномоченное подразделение не позднее 18.30 часов времени города Нур-Султан в день проведения депозитного аукциона размещает на официальном интернет-ресурсе Национального Банка информацию об итогах состоявшегося депозитного аукциона.

Сноска. Пункт 160 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 1
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики

Формула для расчета цены обратной продажи ценной бумаги

$$\text{Цоп} = (C/365 \times N \times \text{Цп}/100) + \text{Цп},$$

где: Цоп – цена обратной продажи ценных бумаг;

Цп – цена покупки ценных бумаг;

C – ставка доходности;

N – срок предоставления ликвидности (в днях).

Приложение 2
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики
Форма

исходящий номер
" ___ " _____ 20__ года

Заявка

на участие в аукционе по покупке ценных бумаг с обратной продажей

по выпуску № _____ от " ___ " _____ 20__ года
(указывается уникальный идентификационный номер аукциона)

Участник аукциона _____
(полное наименование и его лицевой счет)

индивидуальный идентификационный код или банковский идентификационный код
_____ выражает готовность продать ценные бумаги Национальному Банку со
сроком обратной покупки _____ дней и датой обратной покупки _____ на
следующих условиях:

Номер заявки	Национальный идентификационный номер ценных бумаг и либо международный идентификационный номер	Лицевой счет участника аукциона	Номинальный объем ценных бумаг (тенге)	Объем продажи по номинальной стоимости (тенге)	Объем покупки по номинальной стоимости (тенге)	Ставка доходности
Заявки с конкурентными предложениями						
Итого:						
Заявки с неконкурентными предложениями						
Итого:						

Руководитель (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

Подпись
Приложение 3
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан аукционов в

Заявка №	Лицевой счет участника аукциона	идентификационный номер ценных бумаг либо международный идентификационный номер	Номинальный объем	Цена покупки	Объем покупки	Цена обратной продажи	Объем обратной продажи	Ставка доходности	Дата обратной продажи
Итого:									

Руководитель уполномоченного подразделения (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

 Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

 Подпись
 Приложение 5
 к Правилам проведения
 Национальным Банком
 Республики Казахстан
 аукционов в рамках реализации
 денежно-кредитной политики

Формула для расчета цены обратной покупки ценной бумаги

$$Цор = (C/365 \times N \times Цр/100) + Цр,$$

где: Цор – цена обратной покупки ценных бумаг;

Цр – цена продажи ценных бумаг;

С – ставка доходности;

N – срок изъятия ликвидности (в днях).

 Приложение 6
 к Правилам проведения
 Национальным Банком
 Республики Казахстан
 аукционов в рамках реализации
 денежно-кредитной политики
 Форма

исходящий номер
 " ____ " _____ 20__ года

Заявка на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой

по выпуску № _____ от " ____ " _____ 20__ года
 (указывается уникальный идентификационный номер аукциона)

Участник аукциона _____

(полное наименование и его лицевой счет)

индивидуальный идентификационный код или банковский идентификационный код _____ выражает готовность купить ценные бумаги у Национального Банка со сроком обратной продажи _____ дней и датой обратной продажи _____ на следующих условиях:

Номер заявки	Лицевой счет участника аукциона	Объем (тенге)	Ставка доходности (в процентах)
Заявки с конкурентными предложениями			
Итого:			
Заявки с неконкурентными предложениями			
Итого:			

Руководитель (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

Подпись

Приложение 7
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики
Форма

Сводная ведомость поступивших заявок на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой

Аукцион № _____ от " ____ " _____ 20 ____ года.

Максимальная ставка _____ (в процентах).

Объявленный объем _____.

№ п/п	Участник аукциона	Вид заявки	Номер заявки	Объем покупки ценных бумаг, тенге	Процентная ставка	объем с учетом объявленных ограничений				объем без учета объявленных ограничений			
						конкурентные	неконкурентные	и того	средняя ставка	конкурентные	неконкурентные	и того	средняя ставка
1													

Итого: _____ тенге,

в том числе количество заявок с неконкурентными предложениями _____ тенге.

Руководитель уполномоченного подразделения (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

Подпись

Приложение 8
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики
Форма

Уведомление об удовлетворенном объеме заявок по аукциону по продаже ценных бумаг с обратной покупкой № _____ от " ____ " _____ 20__ года

Национальный Банк уведомляет о том, что Ваша заявка на участие в аукционе по продаже ценных бумаг с обратной покупкой № _____ от " ____ " _____ 20__ года удовлетворена на сумму _____ тенге.

Средневзвешенная ставка аукциона _____ (в процентах).

Дата закрытия аукциона _____.

Общий объем удовлетворенных заявок _____ тенге.

Заявка №	Национальный идентификационный номер ценных бумаг либо международный идентификационный номер	Номинальный объем ценной бумаги	Цена продажи ценной бумаги	Объем открытия	Цена обратной покупки ценной бумаги	Объем закрытия	Ставка
Итого:							

Руководитель уполномоченного подразделения (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

Подпись

Приложение 9
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики

Формула для расчета ставки вознаграждения по краткосрочным нотам Национального Банка

РН-Рд 365 ----- х ----- х 100, Рд То

где: Рн – номинальная стоимость;

Рд – дисконтированная цена;

То – период обращения (в днях).

Приложение 10
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики
Форма

исходящий номер

" ___ " _____ 20__ года

Форма размещения (электронный аукцион, (доразмещение), аукцион по продаже, аукцион в форме подписки)

Заявка на покупку краткосрочных нот Национального Банка

по выпуску № _____ от " ___ " _____ 20__ года

(указывается номер выпуска, исходя из условий выпуска и размещения краткосрочных нот Национального Банка)

Первичный агент _____

(полное наименование и его лицевой счет)

корреспондентский счет, открытый в Национальном Банке № _____,
индивидуальный идентификационный код или банковский идентификационный код _____

выражает готовность купить краткосрочные ноты Национального Банка со сроком обращения _____ дней и датой погашения _____ по следующим ценовым условиям:

№	Количество краткосрочных нот (штук)	Лицевой счет первичного агента или инвестора	Номинальная стоимость одной краткосрочной ноты (тенге)	Объем покупки по номинальной стоимости (тенге)	Дисконтированная цена одной краткосрочной ноты (тенге)	Объем покупки по дисконтированной цене (тенге)
Заявки с конкурентными предложениями						
Итого:						
Заявки с неконкурентными предложениями						
Итого:						

Руководитель (на период его отсутствия – лицо, его замещающее)

Фамилия, имя, отчество (при его наличии)

Подпись

Приложение 11
к Правилам проведения
Национальным Банком
Республики Казахстан
аукционов в рамках реализации
денежно-кредитной политики
Форма

Заявка на участие в депозитном аукционе

Сноска. Приложение 11 исключено постановлением Правления Национального Банка РК от 26.07.2019 № 127 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

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