

О внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам рынка ценных бумаг

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 сентября 2018 года № 217. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 25 сентября 2018 года № 17423

П р и м е ч а н и е Р Ц П И !

Порядок введения в действие настоящего постановления см. п. 5.

В целях совершенствования нормативных правовых актов Республики Казахстан Правление Национального Банка Республики Казахстан ПОСТАНОВЛЯЕТ:

1. Утвердить Перечень нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам рынка ценных бумаг, в которые вносятся изменения (далее – Перечень), согласно приложению к настоящему постановлению.

2. Департаменту регулирования небанковских финансовых организаций (Кошербаева 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 3 настоящего постановления.

3. 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.

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

5. Настоящее постановление вводится в действие после дня его первого официального опубликования, за исключением Перечня, который вводится в действие с 1 января 2019 года.

*Председатель
Национального Банка*

Д. Акишев

Приложение
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 24 сентября 2018 года № 217

Перечень нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам рынка ценных бумаг, в которые вносятся изменения

1. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 декабря 2003 года № 409 "Об утверждении Правил осуществления деятельности платежного агента на рынке ценных бумаг в Республике Казахстан" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 2632, опубликовано 23 января 2004 года в газете "Казахстанская правда" № 13 (24323) следующие изменения:

заголовок изложить в следующей редакции:

"Об утверждении Правил осуществления деятельности платежного агента";

пункт 1 изложить в следующей редакции:

"1. Утвердить прилагаемые Правила осуществления деятельности платежного агента.";

в Правилах осуществления деятельности платежного агента на рынке ценных бумаг в Республике Казахстан, утвержденных указанным постановлением:

текст в правом верхнем углу изложить в следующей редакции:

"Утверждены
постановлением Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 2 декабря 2003 года № 409";

заголовок изложить в следующей редакции:

"Правила осуществления деятельности платежного агента";

пункт 1 изложить в следующей редакции:

"1. Настоящие Правила осуществления деятельности платежного агента определяют условия и порядок осуществления деятельности платежного агента на рынке ценных бумаг в Республике Казахстан.";

пункт 3 изложить в следующей редакции:

"3. Сведения о платежном агенте содержатся в проспекте выпуска эмиссионных ценных бумаг.";

подпункт 4) пункта 5 изложить в следующей редакции:

"4) международный идентификационный номер (код ISIN);";

пункт 7 изложить в следующей редакции:

"7. Платежный агент в случае полной выплаты дохода по эмиссионным ценным бумагам и номинальной стоимости облигаций при их погашении в течение одного месяца после окончания срока погашения, установленного проспектом выпуска облигаций, направляет в Национальный Банк Республики Казахстан уведомление об итогах погашения негосударственных облигаций в порядке, установленном нормативным правовым актом Национального Банка Республики Казахстан в соответствии с пунктом 5 статьи 32 Закона Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг".";

пункт 11 исключить.

2. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 59 "Об утверждении Требований к системе управления рисками клиринговой организации, условиям и порядку мониторинга, контроля и управления рисками в клиринговой организации" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7554, опубликовано 23 июня 2012 года в газете "Казахстанская правда" № 199-200 (27018-27019) следующие изменения:

в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

в пункт 1 внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

в Требованиях к системе управления рисками клиринговой организации, условиям и порядку мониторинга, контроля и управления рисками в клиринговой организации, утвержденных указанным постановлением:

в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

в преамбулу внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

подпункт 2) пункта 1 изложить в следующей редакции:

"2) клиринг - процесс определения, проверки и передачи информации о требованиях и (или) обязательствах клиринговых участников в результате совершения ими сделок с финансовыми инструментами";

подпункт 4) пункта 3 изложить в следующей редакции:

"4) требования к организации деятельности по осуществлению сделок с финансовыми инструментами";

в пункте 9:

подпункт 2) изложить в следующей редакции:

"2) сбор, ввод, хранение и распространение информации, предоставляемой клиринговыми участниками, фондовой (товарной) биржей, центральным депозитарием и (или) расчетной организацией;"

подпункт 7) изложить в следующей редакции:

"7) инвестирование активов клиринговой организации в финансовые инструменты;"

подпункты 12), 13) и 14) изложить в следующей редакции:

"12) мониторинг финансового состояния клиринговых участников, а также на предмет их соответствия требованиям внутренних документов клиринговой организации;

13) определение порядка организации работы с клиринговыми участниками, в том числе определение процедур по рассмотрению и разрешению споров, а также применению соответствующих мер в случае невыполнения клиринговыми участниками своих обязательств;

14) формирование и использование резервных или гарантийных клиринговых фондов.";

в пункте 10:

подпункт 2) изложить в следующей редакции:

"2) порядок инвестирования активов клиринговой организации;"

подпункты 7), 8) и 9) изложить в следующей редакции:

"7) порядок и условия мониторинга и контроля клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, внутренних документов клиринговой организации и требованиям к финансовому состоянию клиринговых участников;

8) порядок и условия формирования, а также использования резервных или гарантийных клиринговых фондов;

9) требования к клиринговым участникам;"

в пункте 11:

подпункт 1) изложить в следующей редакции:

"1) полномочия и функциональные обязанности совета директоров, правления, ответственного подразделения клиринговой организации по управлению рисками и подразделения клиринговой организации по мониторингу и контролю клиринговых участников, а также порядок обмена информацией между данными органами и подразделениями;"

абзацы пятый и шестой подпункта 6) изложить в следующей редакции:

"механизм незамедлительного представления отчетности совету директоров о любых значительных случаях, способных повлечь за собой ответственность клиринговой организации по сделкам, заключенным клиринговыми участниками в торговой системе фондовой (товарной) биржи;

мониторинг рисков, проводимый ответственным подразделением клиринговой организации по мониторингу и контролю клиринговых участников, включающий мониторинг изменения значений показателей рисков клиринговых участников и максимально допустимых значений данных показателей рисков, а также мер, предпринимаемых в целях минимизации рисков в случае несоответствия значений показателей рисков максимально допустимым значениям показателей рисков.";

пункты 12, 13 и 14 изложить в следующей редакции:

"12. Порядок инвестирования активов клиринговой организации устанавливает условия и порядок осуществления сделок с финансовыми инструментами, типовые формы документов, используемых в процессе осуществления сделок с финансовыми инструментами и включает описание процедур по:

1) разработке политики инвестирования активов клиринговой организации;

2) подготовке рекомендаций для принятия инвестиционных решений, предусматривающих:

перечень должностей лиц, уполномоченных на выдачу рекомендаций;

порядок осуществления анализа состояния инвестиционного портфеля;

порядок осуществления анализа наличия, условий обращения и доходности финансовых инструментов, в которые предполагается осуществить инвестирование;

порядок осуществления анализа рисков, связанных с финансовыми инструментами, в которые предполагается осуществить инвестирование;

порядок осуществления анализа факторов, существенных для выдачи рекомендаций ;

3) принятию инвестиционных решений, содержащих описание работы инвестиционного комитета, периодичность проведения и оформления результатов заседаний;

4) взаимодействию органов и подразделений клиринговых организаций в процессе подготовки, принятия и исполнения инвестиционных решений;

5) заключению сделок с финансовыми инструментами и осуществлению контроля за их исполнением, содержащих описание процессов по взаимодействию с посредником (брокером), с помощью которого предполагается заключение сделки (при наличии такового), контролю за совершением сделок, осуществлению сверок состава и движения активов, ведению внутреннего учета и документооборота заключенных сделок, а также перечень руководящих работников, осуществляющих контроль за заключением сделок с финансовыми инструментами;

6) подготовке правлением клиринговой организации отчетности о результатах деятельности по операциям с финансовыми инструментами.

13. В целях обеспечения заключения сделок с финансовыми инструментами клиринговой организацией разрабатывается политика инвестирования активов, включающая, но не ограничивающаяся следующим:

- 1) цели и стратегия инвестирования активов;
- 2) описание и перечень объектов инвестирования;
- 3) лимиты инвестирования активов по видам финансовых инструментов;
- 4) условия и ограничения, установленные в отношении сделок с финансовыми инструментами;
- 5) условия хеджирования и диверсификации активов с указанием перечня и описания инструментов хеджирования;
- 6) информация об основных рисках, связанных с инвестированием активов.

14. Политика инвестирования активов клиринговой организации и все изменения и дополнения в нее утверждаются советом директоров клиринговой организации.";

подпункты 4) и 5) пункта 18 изложить в следующей редакции:

"4) порядок разрешения вопросов между клиринговыми участниками и клиринговой организацией в процессе осуществления клиринга по заключаемым в торговой системе фондовой (товарной) биржи сделкам;

5) порядок и условия обмена информацией между клиринговой организацией и клиринговыми участниками, фондовой (товарной) биржей, центральными депозитарием и (или) иной расчетной организацией.";

пункты 19 и 20 изложить в следующей редакции:

"19. Порядок и условия мониторинга и контроля клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов клиринговой организации включают:

1) перечень отчетов клиринговых участников и иной информации, необходимых для мониторинга их финансового состояния;

2) условия и сроки предоставления отчетов и иной информации, указанных в подпункте 1) настоящего пункта;

3) порядок и сроки рассмотрения клиринговой организацией отчетов и иной информации, указанных в подпункте 1) настоящего пункта;

4) методику оценки финансового состояния клиринговых участников;

5) порядок и сроки составления и представления сводных отчетов о финансовом состоянии клиринговых участников руководящим работникам и подразделениям клиринговой организации;

6) порядок и условия применения мер в отношении клирингового участника, не соответствующего требованиям, установленным к финансовому состоянию клиринговых участников;

7) годовой план мониторинга клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов клиринговой организации;

8) порядок и условия проведения проверки клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов клиринговой организации;

9) методика оценки соответствия клиринговых участников требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников и внутренних документов клиринговой организации;

10) порядок и сроки оформления результатов проверки клиринговых участников и представления данной информации руководящим работникам и подразделениям клиринговой организации;

11) порядок и условия применения мер в отношении клирингового участника, не соответствующего требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов клиринговой организации.

20. Порядок и условия формирования, а также использования резервных или гарантийных фондов клиринговой организации и (или) маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников включают:

1) методику определения и оценки размеров резервных или гарантийных фондов клиринговой организации и (или) маржевых взносов, иного обеспечения клиринговых участников;

2) порядок и условия уплаты маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников, взносов клиринговых участников в гарантийный фонд клиринговой организации, формирования резервного фонда клиринговой организации;

3) порядок и условия осуществления выплат из резервных или гарантийных фондов клиринговой организации;

4) порядок и условия инвестирования активов резервных или гарантийных фондов клиринговой организации:

в деньги на корреспондентском счете, открытом в Национальном Банке Республики Казахстан, или на банковском счете, открытом в Акционерном обществе "Центральный депозитарий ценных бумаг";

в деньги на счетах в иностранных банках-корреспондентах, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "B+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в государственные ценные бумаги Республики Казахстан;

в государственные облигации иностранных государств, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "AA" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в инструменты репо, осуществляемые "автоматическим" способом;

в депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "BB+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в депозиты в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в корпоративные облигации (в том числе купонные международные облигации), имеющие рейтинг не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в квазигосударственные долговые ценные бумаги резидентов Республики Казахстан, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BB+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

5) порядок и условия инвестирования денег, внесенных в уплату маржевых взносов и (или) в качестве иного обеспечения:

в деньги на корреспондентском счете, открытом в Национальном Банке Республики Казахстан, или на банковском счете, открытом в Акционерном обществе "Центральный депозитарий ценных бумаг";

в деньги на счетах в иностранных банках-корреспондентах, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "B+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в государственные ценные бумаги Республики Казахстан;

в государственные облигации иностранных государств, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "AA" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в инструменты репо, осуществляемые "автоматическим" способом;

в депозиты в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service.";

в пункте 21:

абзац первый изложить в следующей редакции:

"21. Требования к клиринговым участникам включают следующие требования к:";

в подпункт 3) внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

пункт 26 изложить в следующей редакции:

"26. Организационная структура клиринговой организации включает в себя подразделение, основной функцией которого является мониторинг и контроль клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов клиринговой организации.";

в пункте 30:

абзац первый изложить в следующей редакции:

"30. Подразделение, осуществляющее управление рисками, совместно с подразделением, осуществляющим мониторинг и контроль клиринговых участников, и подразделением правового обеспечения (юридическим подразделением) клиринговой организации обеспечивают регулирование правовых рисков, возникающих вследствие нарушения клиринговой организацией требований финансового законодательства Республики Казахстан, в том числе несоответствия внутренних документов клиринговой организации требованиям финансового законодательства Республики Казахстан, несоответствия практики деятельности клиринговой организации ее внутренним документам, путем:";

подпункт 2) изложить в следующей редакции:

2) осуществления контроля за соответствием деятельности клиринговых участников требованиям, установленным законодательством Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, внутренними правилами клиринговой организации;"

подпункт 5) пункта 44 изложить в следующей редакции:

"5) формированию дополнительных гарантийных или резервных фондов клиринговой организации в случаях, предусмотренных внутренними документами клиринговой организации.";

пункт 46 изложить в следующей редакции:

"46. Требования к организации деятельности по осуществлению сделок с финансовыми инструментами за счет активов клиринговой организации устанавливаются внутренними документами клиринговой организации, определяющими порядок инвестирования активов клиринговой организации.";

подпункт 1) пункта 48 изложить в следующей редакции:

"1) операционная и финансовая эффективность деятельности клиринговой организации, что предполагает проверку эффективности управления активами клиринговой организации, процедур клиринга, исполнения надзорных функций в отношении клиринговых участников и определения вероятности убытков;"

подпункт 9) пункта 50 изложить в следующей редакции:

"9) проверка эффективности надзорных процедур в отношении клиринговых участников;"

в приложение внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется.

3. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 88 "Об утверждении Правил исполнения представителем держателей облигаций своих функций и обязанностей, досрочного прекращения его полномочий, а также требований к содержанию договора о представлении интересов держателей облигаций, заключаемого между эмитентом и представителем держателей облигаций, и сроков предоставления информации в Национальный Банк Республики Казахстан" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7568, опубликовано 1 августа 2012 года в газете "Казахстанская правда" № 245-246 (27064-27065) следующие изменения:

в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

в пункт 1 внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

в Правилах исполнения представителем держателей облигаций своих функций и обязанностей, досрочного прекращения его полномочий, а также требованиях к содержанию договора о представлении интересов держателей облигаций, заключаемого между эмитентом и представителем держателей облигаций, и сроках

предоставления информации в Национальный Банк Республики Казахстан, утвержденных указанным постановлением:

в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

преамбулу изложить в следующей редакции:

"Настоящие Правила исполнения представителем держателей облигаций своих функций и обязанностей, досрочного прекращения его полномочий, а также требования к содержанию договора о представлении интересов держателей облигаций, заключаемого между эмитентом и представителем держателей облигаций, и сроки предоставления информации в Национальный Банк Республики Казахстан (далее - Правила) разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг" (далее - Закон) и определяют порядок исполнения представителем держателей облигаций (далее – представитель) своих функций и обязанностей при выпуске, размещении, обращении и погашении обеспеченных, инфраструктурных или ипотечных облигаций (далее – облигации), требования к содержанию договора о представлении интересов держателей облигаций, заключаемого между эмитентом и представителем, порядок и случаи досрочного прекращения его полномочий, а также сроки предоставления информации в Национальный Банк Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган) в соответствии с подпунктом 5) пункта 1 статьи 20 Закона.";

часть четвертую пункта 1-1 изложить в следующей редакции:

"Эмитент, являющийся банком второго уровня, представляет представителю отчет об остатках на балансовых и внебалансовых счетах банков второго уровня, составленный по форме согласно приложению 2 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 июня 2018 года № 137 "Об утверждении перечня, форм, сроков отчетности банков второго уровня Республики Казахстан и Правил их представления", зарегистрированному в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 17313.";

часть первую пункта 3 изложить в следующей редакции:

"3. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения эмитентом обязательств по выплате вознаграждения и (или) номинальной стоимости облигаций, а также наступлении случаев, влекущих последствия, связанные с неисполнением условий, предусмотренных пунктом 2 статьи 15 Закона и проспектом выпуска облигаций, представитель в срок не позднее одного рабочего дня со дня получения данных сведений информирует об этом уполномоченный орган, держателей облигаций и фондовую биржу (в случае, если облигации включены в официальный список фондовой биржи) с описанием мер, предпринимаемых представителем в рамках осуществления своих функций и реализации своих прав по заключенному договору с эмитентом.";

подпункт 6) пункта 6 изложить в следующей редакции:

"6) извещает уполномоченный орган и держателей облигаций о прекращении его полномочий в качестве представителя в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты расторжения или с даты истечения срока действия договора с эмитентом;"

4. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 января 2016 года № 11 "Об утверждении Требований к системе управления рисками центрального контрагента, условиям и порядку мониторинга, контроля и управления рисками центрального контрагента" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 13314, опубликовано 14 марта 2016 года в информационно-правовой системе "Әділет") следующие изменения:

в Требованиях к системе управления рисками центрального контрагента, условиям и порядку мониторинга, контроля и управления рисками центрального контрагента, утвержденных указанным постановлением :

пункт 2 изложить в следующей редакции:

"2. В Требованиях используются следующие понятия:

1) ценовой риск - риск возникновения расходов (убытков) вследствие изменения стоимости финансовых инструментов, возникающий в случае изменения условий финансовых рынков, влияющих на рыночную стоимость финансовых инструментов, товаров;

2) репутационный риск - вероятность возникновения потерь, неполучения запланированных доходов в результате сужения клиентской базы, снижения иных показателей развития вследствие формирования в обществе негативного представления о финансовой надежности центрального контрагента, качестве оказываемых услуг или характере деятельности центрального контрагента в целом;

3) валютный риск - вероятность возникновения финансовых потерь вследствие неблагоприятных изменений курсов иностранных валют при осуществлении центральным контрагентом своей деятельности;

4) расчетная организация - организация, осуществляющая организацию расчетов (платежей) по сделкам с финансовыми инструментами;

5) гарантийный фонд – средства, сформированные за счет взносов клиринговых участников и предназначенные для снижения рисков деятельности клиринговой организации (центрального контрагента) при обслуживании клиринговых участников;

6) кредитный риск - вероятность возникновения потерь, возникающая вследствие невыполнения контрагентом своих обязательств в соответствии с оговоренными условиями;

7) правовой риск - вероятность возникновения потерь вследствие:

нарушения контрагентами требований нормативных правовых актов Республики Казахстан, а также условий заключенных договоров;

несовершенства правовой системы (противоречивости законодательства, отсутствия правовых норм по регулированию отдельных вопросов, возникающих в процессе деятельности центрального контрагента);

допущения правовых ошибок при осуществлении деятельности (неправильные юридические консультации или неверное составление документов, в том числе при рассмотрении спорных вопросов в судебных органах);

несоблюдения центральным контрагентом требований законодательства Республики Казахстан, а в отношениях с нерезидентами Республики Казахстан - применимого законодательства других государств;

несоблюдения центральным контрагентом условий заключенных договоров;

8) операционный риск - вероятность возникновения потерь в результате неадекватных или недостаточных внутренних процессов, человеческих ресурсов и систем или внешних событий, в том числе:

риск, вызванный неадекватными стратегиями, политиками и (или) стандартами в области информационных технологий, недостатками использования программного обеспечения;

риск, связанный с неадекватной информацией либо ее несоответствующим использованием;

риск, связанный с неадекватным построением бизнес-процессов либо слабым контролем за соблюдением внутренних документов и правил;

риск, связанный с неопределенной, неадекватной организационной структурой центрального контрагента, включая распределение ответственности, структуру подотчетности и управления;

риск, связанный с несоответствующим управлением персоналом и (или) неквалифицированным персоналом центрального контрагента;

риск, связанный с несоответствием внутренних документов центрального контрагента требованиям законодательства;

риск, связанный с действиями персонала банка, который негативно отразится на деятельности центрального контрагента, мошенничество;

риск, вызванный непредвиденными или неконтролируемыми факторами внешнего воздействия на операции центрального контрагента;

9) центральный контрагент – организация, осуществляющая клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами, а также отдельные виды банковских операций, и выступающая стороной по сделкам, заключаемым на организованном и неорганизованном рынках ценных бумаг, а также на товарной бирже для каждого продавца и каждого покупателя финансового инструмента;

10) риск потери ликвидности - вероятность возникновения потерь в результате неспособности центрального контрагента выполнить свои обязательства в установленный срок без значительных убытков;

11) процентный риск - вероятность возникновения финансовых потерь вследствие неблагоприятного изменения рыночных процентных ставок по активам, пассивам и внебалансовым инструментам;

12) резервный фонд - средства, сформированные за счет собственных активов центрального контрагента и предназначенные для снижения рисков деятельности центрального контрагента;

13) стресс - тестинг - методы измерения потенциального влияния на финансовое положение центрального контрагента исключительных, но возможных событий, которые оказывают влияние на деятельность центрального контрагента;

14) риск - вероятность того, что ожидаемые или непредвиденные события оказывают негативное влияние на центральный контрагент, его капитал или доходы;

15) уполномоченный орган - уполномоченный орган по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций.";

подпункт 4) пункта 4 изложить в следующей редакции:

"4) требования к организации деятельности по осуществлению сделок с финансовыми инструментами;"

в пункте 10:

подпункт 1) изложить в следующей редакции:

1) сбор, ввод, хранение и распространение информации, предоставляемой клиринговыми участниками, фондовой биржей, центральным депозитарием и (или) расчетной организацией;

подпункты 4) и 5) изложить в следующей редакции:

"4) инвестирование активов центрального контрагента в финансовые инструменты;

5) формирование и использование резервных или гарантийных фондов, маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников;"

подпункт 7) изложить в следующей редакции:

"7) определение порядка организации работы с клиринговыми участниками, в том числе определение процедур по рассмотрению и разрешению споров, а также применению соответствующих мер в случае невыполнения клиринговыми участниками своих обязательств;"

абзац пятый подпункта 8) изложить в следующей редакции:

"мониторинг финансового состояния клиринговых участников, а также на предмет их соответствия требованиям внутренних документов центрального контрагента;"

в пункте 11:

подпункты 2) и 3) изложить в следующей редакции:

"2) порядка инвестирования активов центрального контрагента;

3) порядка и условий формирования, а также использования резервного или гарантийного фондов центрального контрагента;"

подпункты 7) и 8) изложить в следующей редакции:

"7) условий и порядка мониторинга и контроля клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, внутренних документов центрального контрагента и требованиям к финансовому состоянию клиринговых участников;

8) требований к клиринговым участникам;"

в пункте 12:

подпункт 1) изложить в следующей редакции:

"1) полномочия и функциональные обязанности совета директоров, правления, ответственного подразделения центрального контрагента по управлению рисками и подразделения центрального контрагента по мониторингу и контролю клиринговых участников, а также порядок обмена информацией между данными органами и подразделениями;"

абзацы пятый и шестой подпункта 7) изложить в следующей редакции:

"механизм незамедлительного представления отчетности совету директоров о любых значительных случаях, способных повлечь за собой ответственность центрального контрагента по сделкам, заключенным клиринговыми участниками в торговой системе фондовой биржи, подразделением, в функции которого входит выявление таких случаев;

мониторинг рисков, проводимый ответственным подразделением центрального контрагента по мониторингу и контролю клиринговых участников, включающий мониторинг изменения значений показателей рисков клиринговых участников и максимально допустимых значений данных показателей рисков, а также мер, предпринимаемых в целях минимизации рисков в случае несоответствия значений показателей рисков максимально допустимым значениям показателей рисков.";

пункты 13, 14, 15, 16, 17 и 18 изложить в следующей редакции:

"13. Порядок инвестирования активов центрального контрагента устанавливает условия и порядок осуществления сделок с финансовыми инструментами, типовые формы документов, используемых в процессе осуществления сделок с финансовыми инструментами, и включает описание процедур по:

1) разработке политики инвестирования активов центрального контрагента;

2) подготовке рекомендаций для принятия инвестиционных решений в отношении активов центрального контрагента, предусматривающих:

перечень должностей лиц, уполномоченных на выдачу рекомендаций;

порядок осуществления анализа состояния инвестиционного портфеля;

порядок осуществления анализа наличия, условий обращения и доходности финансовых инструментов, в которые предполагается осуществить инвестирование;

порядок осуществления анализа рисков, связанных с финансовыми инструментами, в которые предполагается осуществить инвестирование;

порядок осуществления анализа факторов, существенных для выдачи рекомендаций ;

3) принятию инвестиционных решений в отношении активов центрального контрагента, содержащих описание работы инвестиционного комитета, периодичность проведения и оформления результатов заседаний;

4) взаимодействию органов и подразделений центрального контрагента в процессе подготовки, принятия и исполнения инвестиционных решений, в том числе в части управления потенциальными конфликтами интересов между осуществлением функций центрального контрагента и инвестирования активов центрального контрагента;

5) заключению сделок с финансовыми инструментами и осуществлению контроля за их исполнением, содержащих описание процессов по взаимодействию с посредником (брокером), с помощью которого предполагается заключение сделки (при наличии такового), контролю за совершением сделок, осуществлению сверок состава и движения активов, ведению внутреннего учета и документооборота заключенных сделок, а также перечень руководящих работников, осуществляющих контроль за заключением сделок с финансовыми инструментами;

6) подготовке правлением центрального контрагента отчетности о результатах деятельности по операциям с финансовыми инструментами.

14. В целях обеспечения заключения сделок с финансовыми инструментами центрального контрагента разрабатывается политика инвестирования активов, включающая, но не ограничивающаяся следующим:

1) цели и стратегия инвестирования активов;

2) описание и перечень объектов инвестирования активов;

3) лимиты инвестирования активов по видам финансовых инструментов;

4) условия и ограничения, установленные в отношении сделок с финансовыми инструментами;

5) условия хеджирования и диверсификации активов с указанием перечня и описания инструментов хеджирования;

6) информацию об основных рисках, связанных с инвестированием активов.

15. Политика инвестирования активов центрального контрагента и все изменения и дополнения в нее утверждаются советом директоров центрального контрагента.

16. Порядок и условия формирования, а также использования резервных или гарантийных фондов, маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников включают:

1) методику определения и оценки размеров резервных или гарантийных фондов центрального контрагента, маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников;

2) порядок и условия уплаты маржевых взносов и иного обеспечения клиринговых участников, взносов клиринговых участников в гарантийный фонд центрального контрагента, формирования резервного фонда центрального контрагента;

3) порядок и условия осуществления выплат из резервных или гарантийных фондов центрального контрагента;

4) порядок и условия инвестирования активов резервных или гарантийных фондов центрального контрагента:

в деньги на корреспондентском счете, открытом в Национальном Банке Республики Казахстан, или на банковском счете, открытом в Акционерном обществе "Центральный депозитарий ценных бумаг";

в деньги на счетах в иностранных банках-корреспондентах, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "B+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в государственные ценные бумаги Республики Казахстан;

в государственные облигации иностранных государств, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "AA" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в инструменты репо, осуществляемые "автоматическим" способом;

в депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "BB+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в депозиты в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в корпоративные облигации (в том числе купонные международные облигации), имеющие рейтинг не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в квазигосударственные долговые ценные бумаги резидентов Республики Казахстан, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BB+" по международной

шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

5) порядок и условия инвестирования денег, внесенных в уплату маржевых взносов и (или) в качестве иного обеспечения:

в деньги на корреспондентском счете, открытом в Национальном Банке Республики Казахстан, или на банковском счете, открытом в Акционерном обществе "Центральный депозитарий ценных бумаг";

в деньги на счетах в иностранных банках-корреспондентах, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "B+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в государственные ценные бумаги Республики Казахстан;

в государственные облигации иностранных государств, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "AA" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service;

в инструменты репо, осуществляемые "автоматическим" способом;

в депозиты в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный международный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по международной шкале агентств Fitch или Moody's Investors Service.

17. Требования к организации деятельности по осуществлению сделок с финансовыми инструментами, устанавливаются законодательством Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регулирующим деятельность лиц, которые осуществляют функции центрального контрагента.

18. Суммарный размер клиринговых (гарантийных и резервных) фондов клиринговой организации, формируемых центральным контрагентом по каждому рынку, определяется центральным контрагентом исходя из необходимости поддержания их размеров на уровне не ниже размера потенциальных убытков центрального контрагента в случае неисполнения обязательств двумя участниками клиринга с наибольшим объемом указанных обязательств.

Центральный контрагент размещает деньги, составляющие клиринговые (гарантийные или резервные) фонды, маржевые взносы и деньги клиринговых участников в соответствии с внутренними документами центрального контрагента.

Центральный контрагент оценивает позиции участников по текущей рыночной стоимости и взимает маржевое обеспечение с клиринговых участников не реже одного раза в день, чтобы ограничить накопление текущих рисков.

Требования клиринговой организации к размеру обеспечения клиринговых участников определяется с допущением вероятности, соответствующей уровню надежности, не менее девяноста девяти процентов.";

пункт 22 изложить в следующей редакции:

"22. Условия и порядок мониторинга и контроля клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и требованиям к финансовому состоянию клиринговых участников, включают:

1) перечень отчетов клиринговых участников и иной информации, необходимых для мониторинга их финансового состояния;

2) условия и сроки предоставления отчетов и иной информации, указанных в подпункте 1) настоящего пункта;

3) порядок и сроки рассмотрения центральным контрагентом отчетов и иной информации, указанных в подпункте 1) настоящего пункта;

4) методику оценки финансового состояния клиринговых участников;

5) порядок и сроки составления и представления сводных отчетов о финансовом состоянии клиринговых участников руководящим работникам и подразделениям центрального контрагента;

6) порядок и условия применения мер в отношении клирингового участника, не соответствующего требованиям, установленным к финансовому состоянию клиринговых участников;

7) годовой план мониторинга клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов центрального контрагента;

8) порядок и условия проведения проверки клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов центрального контрагента;

9) методику оценки соответствия клиринговых участников требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов центрального контрагента;

10) порядок и сроки оформления результатов проверки клиринговых участников и представления данной информации руководящим работникам и подразделениям центрального контрагента;

11) порядок и условия применения мер в отношении клирингового участника, не соответствующего требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов центрального контрагента.";

абзац первый пункта 23 изложить в следующей редакции:

"23. Требования к клиринговым участникам включают требования к:";

пункт 28 изложить в следующей редакции:

"28. Организационная структура центрального контрагента включает в себя подразделение, основной функцией которого является мониторинг и контроль клиринговых участников на предмет соответствия требованиям законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, регламентирующего порядок их деятельности в качестве клиринговых участников, и внутренних документов центрального контрагента.";

абзац первый пункта 31 изложить в следующей редакции:

"31. Подразделение, осуществляющее управление рисками, совместно с подразделением, осуществляющим мониторинг и контроль клиринговых участников, и подразделением правового обеспечения (юридическим подразделением) центрального контрагента обеспечивают регулирование правовых рисков, возникающих вследствие нарушения центральным контрагентом требований законодательства Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, в том числе несоответствия внутренних документов центрального контрагента требованиям нормативных правовых актов Республики Казахстан, несоответствия практики деятельности центрального контрагента ее внутренним документам, путем:";

подпункт 5) пункта 45 изложить в следующей редакции:

"5) формированию дополнительных гарантийных или резервных фондов центрального контрагента в случаях, предусмотренных внутренними документами центрального контрагента.";

пункт 47 изложить в следующей редакции:

"47. Требования к организации деятельности по осуществлению сделок с финансовыми инструментами за счет активов центрального контрагента устанавливаются внутренними документами центрального контрагента, определяющими порядок инвестирования активов центрального контрагента.";

подпункт 9) пункта 51 изложить в следующей редакции:

"9) проверка эффективности надзорных процедур в отношении центрального контрагента;" .

5. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 июля 2018 года № 165 "О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам деятельности организатора торгов" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 17337, опубликовано 6 сентября 2018 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующее изменение:

пункт 6 изложить в следующей редакции:

"6. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования, за исключением абзацев тридцать восьмого и тридцать девятого пункта 1 настоящего постановления, которые вводятся в действие с 1 января 2019 года, абзацев третьего, четвертого, пятого, шестого, девятого, десятого, одиннадцатого, двенадцатого, тринадцатого, четырнадцатого, пятнадцатого, шестнадцатого, семнадцатого, восемнадцатого, девятнадцатого, двадцатого, двадцать первого, двадцать второго, двадцать третьего, двадцать четвертого, двадцать пятого, двадцать шестого, двадцать седьмого, двадцать восьмого, двадцать девятого, тридцатого, тридцать первого, тридцать второго, тридцать третьего, тридцать четвертого, тридцать пятого, тридцать шестого, тридцать седьмого, сорокового, сорок первого, сорок третьего, сорок четвертого, сорок пятого, сорок шестого, сорок седьмого, сорок восьмого, сорок девятого, пятидесятого, пятьдесят первого, пятьдесят второго, пятьдесят третьего, пятьдесят четвертого, пятьдесят пятого, пятьдесят шестого, пятьдесят седьмого, пятьдесят восьмого, пятьдесят девятого, шестидесятого, шестьдесят первого, шестьдесят второго, шестьдесят третьего, шестьдесят четвертого, шестьдесят пятого, шестьдесят шестого, шестьдесят седьмого, шестьдесят восьмого, шестьдесят девятого, семидесятого, семьдесят первого и семьдесят второго пункта 1 настоящего постановления, которые вводятся в действие с 1 июля 2019 года."