



Инструкция о порядке расчета и применения пруденциальных нормативов для организаций, осуществляющих деятельность по управлению портфелем ценных бумаг

Утративший силу

Утверждена постановлением Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 12 июня 1998 г. N 7. Зарегистрирована в Министерстве юстиции Республики Казахстан 29.06.1998 г. N 530. Исключена - постановлением Правления Агентства РК по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 25 сентября 2004 года N 267 (V043200)

У т в е р ж д е н а
постановлением Национальной комиссии
Республики Казахстан по ценным бумагам
от 12 июня 1998 года N 7 <*>

Сноска. Приложение исключено - постановлением Правления Агентства РК по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 25 сентября 2004 года N 267 .

И н с т р у к ц и я о порядке расчета и применения пруденциальных нормативов для организаций, осуществляющих деятельность по управлению портфелем ценных бумаг <*>

*Сноска. Заголовок с изменениями, внесенными постановлением
НКЦБ РК от 30 сентября 2000 года N 82 V001254_ .*

Настоящая Инструкция разработана в соответствии с законами Республики Казахстан Z970077_ "О рынке ценных бумаг" и Z970082_ "Об инвестиционных фондах в Республике Казахстан" и устанавливает пруденциальные нормативы, обязательные к соблюдению организациями, которые осуществляют деятельность по управлению портфелем ценных бумаг (далее именуемыми "Управляющие").

1. Пруденциальный норматив 1 "Собственный капитал"

1. Собственный капитал Управляющего включает:
 - а) уставный капитал;
 - б) дополнительный оплаченный капитал;

- в) дополнительный неоплаченный капитал;
- г) резервный капитал;
- д) нераспределенный доход отчетного года;
- е) нераспределенный доход предыдущих лет;
- з а в ы ч е т о м :
- ж) неоплаченного капитала;
- з) изъятото капитала;
- и) непокрытого убытка отчетного года;
- к) непокрытого убытка предыдущих лет.

2. Размер собственного капитала Управляющего должен быть не менее 20 миллионов тенге.

2. Пруденциальный норматив 2 "Достаточность собственных средств"

3. Достаточность собственных средств Управляющего характеризуется коэффициентом К1, рассчитываемым как отношение размера собственного капитала Управляющего к размеру активов, принятым им в Управление, по формуле:

$$K1 = \frac{СК}{АПУ}, \text{ где}$$

АПУ

К1 - коэффициент достаточности собственных средств

СК - собственный капитал Управляющего, рассчитанный в соответствии с пунктом 1.1 настоящей Инструкции

АПУ - размер активов, принятых Управляющим в управление.

4. Значение коэффициента К1 должно быть не менее 0,015.

3. Пруденциальный норматив 3 "Резервный капитал"

5. Резервный капитал Управляющего должен быть не менее:

- 0,25% от размера активов, принятых Управляющим в управление, если размер таких активов не превышает 5 миллиардов тенге;

- 0,2% от размера активов, принятых Управляющим в управление, если размер таких активов составляет 5 миллиардов тенге и более, но не менее минимального размера резервного капитала, установленного действующим законодательством для организационно-правовой формы данного Управляющего.

6. Резервный капитал Управляющего должен быть сформирован в размере, установленном пунктом 5 настоящей Инструкции, в течение двух лет со дня получения лицензии на право осуществления деятельности по управлению портфелем ценных бумаг.

Настоящая норма не распространяется на Управляющих взаимными фондами,

резервный капитал которых должен быть сформирован в размере, установленном пунктом 5 настоящей Инструкции, в течение одного года со дня получения лицензии на право осуществления деятельности по управлению портфелем ценных бумаг.

7. Резервный капитал Управляющего формируется за счет отчислений из его чистого дохода.

8. При недостаточности чистого дохода Управляющего его резервный капитал должен быть сформирован за счет средств участников Управляющего.

9. В случае, если по истечении срока, определенного пунктом 6 настоящей Инструкции, в результате каких-либо выплат резервный капитал станет меньше размера, установленного пунктом 5 настоящей Инструкции, Управляющий обязан восстановить резервный капитал до указанной величины в течение шести месяцев с момента таковых выплат.

4. Пруденциальный норматив 4 "Максимальный размер вложений в основные средства и другие внеоборотные активы"

10. Максимальный размер вложений собственных средств Управляющего в основные средства и другие внеоборотные активы характеризуется коэффициентом K_2 , рассчитываемым как отношение размера внеоборотных активов Управляющего к размеру его собственного капитала по формуле:

$$K_2 = \frac{И}{СК}, \text{ где}$$

И - внеоборотные активы, включающие в себя:

- а) нематериальные активы по балансовой стоимости
- б) основные средства по балансовой стоимости
- в) инвестиции
- г) долгосрочные финансовые инвестиции

СК - собственный капитал Управляющего, рассчитанный в соответствии с пунктом 1 настоящей Инструкции.

11. Значение коэффициента K_2 не должно превышать 0,7.

5. Общие положения

12. Управляющий обязан представлять Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам (далее именуемой "Национальная комиссия") расчет пруденциальных нормативов и финансовую отчетность, на основании которой был произведен данный расчет в порядке, определенном Национальной комиссией.

13. Управляющий производит расчет пруденциальных нормативов ежедневно

. В случае изменения размеров пруденциальных нормативов по сравнению с ранее представленными Национальной комиссией, Управляющий обязан в течение трех рабочих дней представить Национальной комиссии новый расчет пруденциальных нормативов и финансовую отчетность, на основании которой был произведен данный расчет.

14. В случае нарушения Управляющим пруденциальных нормативов, установленных настоящим Положением, Национальная комиссия вправе в зависимости от тяжести нарушения применить к Управляющему следующие меры воздействия:

- вынести письменное предписание об устранении нарушения;
- потребовать постоянного или временного отстранения от должности любого из работников Управляющего;
- приостановить действие лицензии на осуществление деятельности по управлению портфелем ценных бумаг в порядке, установленном действующим законодательством.

15. Управляющий обязан уведомить Национальную комиссию об исполнении письменного предписания или требования об отстранения от должности в срок, указанный в таком документе.

16. Управляющий вправе обжаловать действия Национальной комиссии в суде. Обжалование письменного предписания Национальной комиссии или требования Национальной комиссии об отстранении от должности не приостанавливает их исполнения.