

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының "Сауда-саттықты ұйымдастырушы үшін пруденциалдық нормативтерді есептеу ережесін бекіту туралы" 2010 жылғы 29 наурыздағы № 41 қаулысына толықтырулар мен өзгерістер енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының 2010 жылғы 29 қазандағы N 160 Қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2010 жылы 3 желтоқсанда N 6661 тіркелді

Р Қ А О - н ы ң е с к е р т у і !

Бұйрықтың қолданысқа енгізілу тәртібін 2-тармақтан қараңыз.

Нормативтік құқықтық актілерді жетілдіру мақсатында, Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігінің (бұдан әрі - Агенттік) **Басқармасы** **ҚАУЛЫ** **ЕТЕДІ:**

1. Агенттік Басқармасының "Сауда-саттықты ұйымдастырушы үшін пруденциалдық нормативтерді есептеу ережесін бекіту туралы" 2010 жылғы 29 наурыздағы № 41 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 6207 тіркелген) мынадай толықтырулар мен өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Сауда-саттықты ұйымдастырушы үшін пруденциалдық нормативтерді есептеу ережесінде:

мынадай мазмұндағы 1-1-тармақпен толықтырылсын:

"1-1. Осы Ережеде мына ұғымдар қолданылады:

1) арнаулы сауда-саттық - қаржы құралын орналастыратын, сататын, сатып алатын, иемденетін жалғыз сатушысы (сатып алушысы) бар қаржы құралын орналастыру, сату, сатып алу немесе иемдену бойынша биржалық сауда-саттық;

2) кепіл қоры - сауда-саттыққа қатысушының (қатысушылардың) міндеттемелерін оның (олардың) төлем қабілетсіздігі жағдайында жабу үшін арналған, сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарына сәйкес сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелерінің кепіл жарналарынан қалыптастырылатын қор;

3) кепілді жарна - сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшесі төлейтін және сауда-саттықты ұйымдастырушы жүргізетін сауда-саттыққа қатысуға оған рұқсат ету үшін және олар қызмет көрсететін сауда мүшелеріне рұқсат ету үшін міндетті талап б о л ы п т а б ы л а т ы н ж а р н а ;

4) маржалық шот - биржалық сауда-саттықтың қатысушылары мерзімді келісім-шарттар бойынша иемденген (сатылған) мерзімді келісім-шарттардың санына пропорционалды төлейтін және сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарына

сәйкес есептелетін мерзімді келісім-шарттар бойынша міндеттемелерді қамтамасыз ету үшін қолданылатын сомаларды есепке алу мақсатында, сауда-саттықты ұйымдастырушысы клиринг мүшесінің атына ашатын шот;

5) мерзімді келісім-шарт - сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарында белгіленген талаптармен, мерзімін ұзартып орындаумен қаржы құралын абсолюттік және шартты сатып алу - сату шарты;

6) резервтік қор - сауда-саттыққа қатысушылардың міндеттемелерін жабу үшін арналған, сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарына сәйкес сауда-саттықты ұйымдастырушының меншікті қаражатынан қалыптастырылатын қор.

7) сауда-саттыққа қатысушысы - сауда-саттықты ұйымдастырушы өткізетін сауда-саттыққа қатысатын сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшесі.";

8, 9-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

"8. Сауда-саттықты ұйымдастырушының ағымдағы өтімділігінің коэффициенті (K_2) мына формула бойынша орташа айлық негізде есептеледі:

K_2 - $\Theta A / (M + T + \Pi)$,

м ұ н д а :

ΘA - осы Ереженің 9-тармағында көрсетілген сауда-саттықты ұйымдастырушының жоғарғы өтімді активтерінің мөлшері;

M - шетел валютасымен сауда-саттық басталғанға дейін алдын ала төлем сомасы, шетел валютасымен сауда-саттық аяқталуы бойынша ақша қаражатының қалдығы, арнаулы сауда-саттық бойынша кепілді жарналардың сомасы, маржалық шоттардағы сома, мерзімді келісім-шарттар нарығы қатысушыларының жарналарынан қалыптастырылатын кепіл қорының мөлшері есебінен құрылатын сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шоттарындағы ақша сомасынан есептелетін сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда-саттыққа қатысушылары алдындағы міндеттемелерінің сомасы;

T - сауда-саттықты ұйымдастырушы өзінің қаражатымен жауапкершілікті көтеретін, сауда-саттыққа қатысушыларының сауда-саттықты ұйымдастырушыға қоятын сауда-саттықтың нәтижесінде қалыптасқан нетто-талаптарының сомасы. Сауда-саттыққа қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушыға қоятын нетто-талаптарының сомасы (T) осы Ереженің 9-1-тармағына сәйкес есептеледі;

Π - сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарында белгіленген, нарықтың тиісті секторларында сауда-саттық жүргізілгенде техникалық іркіліс басталу нәтижесінде мүшеліктің барлық тиісті санаттары бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелеріне сауда-саттықты ұйымдастырушымен өтеуге жататын барынша жоғарғы шығынның сомасы.

9. Жоғары өтімді активтер есебіне мыналар енгізіледі:

1) к а с с а д а ғ ы а қ ш а ;

2) тазартылған қымбат металдар;

3) Қазақстан Республикасының Үкіметі және (немесе) Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған мемлекеттік бағалы қағаздар, "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамы шығарған бағалы қағаздар.

Сауда-саттықты ұйымдастырушы оларды кері сатып алу шарттарымен сатқан немесе Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес кепілге берілген немесе өзгеше ауыртпашылық салынған бағалы қағаздарды қоспағанда, осы тармақшада көрсетілген бағалы қағаздар жоғары өтімді активтердің есебіне қосылады;

4) аталған салымдар бойынша сыйақыны және сауда-саттыққа қатысушылар сауда-саттыққа қатысу үшін және (немесе) сауда-саттықта жасасқан мәмілелер бойынша өздерінің міндеттемелерін орындау үшін сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шотына аударым жасаған ақшаны қоспағанда, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіндегі ағымдағы және корреспонденттік шоттардағы ақша мен салымдар;

5) аталған салымдар бойынша сыйақыны және сауда-саттыққа қатысушылар сауда-саттыққа қатысу үшін және (немесе) сауда-саттықта жасасқан мәмілелер бойынша өздерінің міндеттемелерін орындау үшін сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шотына аударым жасаған ақшаны қоспағанда, жүз пайыз мөлшерінде есепке алынатын Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі және "Standard&Poors" агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді борыштық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резиденттері емес банктеріндегі ағымдағы және корреспонденттік шоттардағы ақша, талап етілгенге дейінгі және мерзімді салымдар;

6) аталған салымдар бойынша сыйақыны және сауда-саттыққа қатысушылар сауда-саттыққа қатысу үшін және (немесе) сауда-саттықта жасасқан мәмілелер бойынша өздерінің міндеттемелерін орындау үшін сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шотына аударым жасаған ақшаны қоспағанда, салым сомасынан сексен пайыз мөлшерінде есепке алынатын, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі және "Standard&Poors" агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+"-тен "BB-" дейінгі ұзақ мерзімді борыштық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар немесе "Standard&Poors" агенттігінің ұлттық шәкілі бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB" дейінгі рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының банктеріндегі ағымдағы және корреспонденттік шоттарындағы ақша, талап етілгенге дейінгі және мерзімді салымдар;

7) аталған салымдар бойынша сыйақыны және сауда-саттыққа қатысушылар

сауда-саттыққа қатысу үшін және (немесе) сауда-саттықта жасалған мәмілелер бойынша өздерінің міндеттемелерін орындау үшін сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шотына аударым жасаған ақшаны қоспағанда, алпыс пайыз мөлшерінде есепке алынатын, "Standard&Poor's" агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "B+"-тен "B"-ге дейінгі ұзақ мерзімді борыштық рейтингі немесе "Standard&Poor" агенттігінің ұлттық шәкілі бойынша басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі ағымдағы және корреспонденттік шоттардағы ақша, талап етілгенге дейінгі салымдар мен мерзімді салымдар.";

мынадай мазмұндағы 9-1-тармақпен толықтырылсын:

"9-1. Сауда-саттыққа қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушыға қоятын нетто-талаптарының сомасы (Т) мына формула бойынша есептеледі:

$$T = \sum_{i=1}^n (C_i - Q_i),$$

м ұ н д а :

n - мүше болудың барлық санаттары бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелерінің саны ;

C_i - сауда-саттықты ұйымдастырушының әр санатының i мүшесінің мүшеліктің осы санатына сәйкес келетін сауда-саттықты ұйымдастырушысының сауда жүйесінің секторында жасалған мәмілелер бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушыға теңге көрсетіліміндегі қойылатын, реттелмеген талаптары;

Q_i - сауда-саттықты ұйымдастырушының әр санатының i мүшесінің мүшеліктің осы санатына сәйкес келетін сауда-саттықты ұйымдастырушысының сауда жүйесінің секторында жасалған мәмілелер бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушыға теңге көрсетіліміндегі қойылатын, реттелмеген міндеттемелері.

Егер сауда-саттықты ұйымдастырушының бір санатының i мүшесі үшін оның реттелмеген талаптары (C_i) мен міндеттемелері (Q_i) арасындағы айырмасы теріс шаманы құраса, онда осы санат бойынша осы мүшенің нетто-талабы нөлге тең болады.

Егер міндеттемелерді (талаптарды) орындау валютасы теңге болмаса, осы міндеттеменің (талаптың) теңге баламасы осы валютаның теңгеге орташа мөлшерленген биржалық бағамы бойынша есептеледі.

Егер есептелген Т мәні сауда-саттықты ұйымдастырушының қаражатынан қалыптастырылған резервтік қордың мөлшерінен көп болса, Т осы резервтік қордың мөлшеріне теңестіріледі.";

10-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"10. Сауда-саттықты ұйымдастырушы K_1 коэффициентінің мәнінің есебін осы Ереженің 1, 2 және 3-қосымшаларына сәйкес, сондай-ақ K_2 коэффициенті үшін көрсеткіштердің есебін осы Ереженің 4-қосымшасына сәйкес алдыңғы жұмыс күнінің соңындағы, сондай-ақ ағымдағы жұмыс күнінің тікелей алдындағы әр демалыс күнінің соңындағы жағдай бойынша әр жұмыс күні жүргізеді.

Сауда-саттықты ұйымдастырушы K_2 коэффициенті мәнінің есебін есептік айдың соңғы жұмыс күнінің соңындағы жағдай бойынша ай сайын жүргізеді.";

4-қосымша осы қаулының қосымшасына сәйкес редакцияда жазылсын;

5 - қ о с ы м ш а д а :

"Пруденциалдық нормативтерді орындау есебі" деген кестеде: реттік нөмірлері 19, 20, 21 және 22-жолдар мынадай редакцияда жазылсын:

"

19	Сауда-саттыққа қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шоттарындағы ақшалары бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда-саттыққа қатысушылары алдындағы міндеттемелерінің орташа айлық сомасы
20	Сауда-саттықты ұйымдастырушы өзінің қаражатымен жауапкершілікті көтеретін, сауда-саттыққа қатысушыларының сауда-саттықты ұйымдастырушыға қоятын нетто-талаптарының орташа айлық сомасы
21	Сауда-саттықты ұйымдастырушысымен техникалық іркіліс басталу нәтижесінде өтеуге жататын мүше болудың барлық санаты бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелеріне келтірілген барынша жоғарғы шығынның орташа айлық сомасы
22	Мүше болудың барлық санаттары бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелерінің саны (бірлікпен)

";

мынадай мазмұндағы реттік нөмірі 23-жолмен толықтырылсын:

"

23	K_2 ағымдағы өтімділік коэффициенті
----	---------------------------------------

";

2. Осы қаулы Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелген күннен бастап он төрт күнтізбелік күн өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі.

Осы қаулының 1-тармағының жиырма сегізінші абзацының қолданысы 2012 жылғы

1 қаңтарға дейін таралады.

3. Стратегия және талдау департаменті (Н.А. Әбдірахманов):

1) Заң департаментімен (Н.В. Сарсенова) бірлесіп, осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеу шараларын қолға алсын;

2) осы қаулы Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелген күннен бастан он күндік мерзімде оны Агенттіктің мүдделі бөлімшелеріне, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне, "Қазақстан қаржыгерлерінің қауымдастығы" заңды тұлғалар бірлестігіне және "Қазақстан қор биржасы" акционерлік қоғамына мәлімет үшін жеткізсін.

4. Ақпараттық технологиялар департаменті (Қ.А. Түсіпов) 2010 жылғы 31

желтоқсанға дейінгі мерзімде "Банктік емес ұйымдар" деген модульді жетілдіруді
қ а м т а м а с ы з е т с і н .

5. Осы қаулының орындалуын бақылау Агенттік Төрайымының орынбасары А.Ө
Алдамбергенге жүктелсін.

Төрайым Е. Бахмутова
Қазақстан Республикасы Қаржы
нарығын және қаржы ұйымдарын
реттеу мен қадағалау агенттігі
Б а с қ а р м а с ы н ы ң
2 0 1 0 жылғы 2 9 қ а з а н д а ғы
№ 160 қаулысына қосымша
"Сауда-саттықты ұйымдастырушы
үшін пруденциалдық нормативтерді
есептеу ережесіне 4-қосымша
Нысан

—
(сауда-саттықты ұйымдастырушының атауы)
201__ жылғы _____ жағдай бойынша
K2 ағымдағы өтімділік коэффициентін ашып жазу

(мың теңге)

№	Күні	Жоғары өтімді активтер	Сауда-саттыққа қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушының корреспонденттік шоттарындағы ақшалары бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда-саттыққа қатысушылары алдындағы міндеттемелерінің сомасы	Сауда-саттықты ұйымдастырушы өзінің қаражатымен жауапкершілікті көтеретін, сауда-саттыққа қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушыға қоятын нетто-талаптарының сомасы	Сауда-саттықты ұйымдастырушысымен техникалық іркіліс басталу нәтижесінде өтеуге жататын мүше болудың барлық санаты бойынша сауда-саттықты ұйымдастырушының мүшелеріне келтірген барынша жоғарғы шығынның сомасы
	1				
	2				
	3				
	4				
	5				
	6				
	7				
	8				

9				
10				
11				
12				
13				
14				
15				
16				
17				
18				
19				
20				
21				
22				
23				
24				
25				
26				
27				
28				
29				
30				
31				
Жиынтығы:				
Орташа айлық шаманың жиынтығы				
Жұмыс күндерінің саны				
Ағымдағы өтімділік коэффициенті				

Бірінші басшы (ол болмаған кезде оның орнындағы адам)

(тегі, аты, бар болса - әкесінің аты)

(қолы)

Б а с

б у х г а л т е р

(тегі, аты, бар болса - әкесінің аты)

(қолы)

О р ы н д а у ш ы :

(лауазымы, тегі және аты)

(қолы)

(телефон нөмірі)".

Есепке қол қойылған күні 20____ жылғы " ____ " _____
Мөр орны".

© 2012. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің «Қазақстан Республикасының Заңнама және
құқықтық ақпарат институты» ШЖҚ РМК