

"Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларын бекіту туралы"
Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2013 жылғы 27 тамыздағы № 214 қаулысына өзгерістер енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 22 желтоқсандағы № 257 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2018 жылғы 16 қаңтарда № 16231 болып тіркелді

Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерін жетілдіру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2013 жылғы 27 тамыздағы № 214 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 8796 болып тіркелген, 2013 жылғы 5 желтоқсанда "Заң газеті" газетінде № 183 (2384) жарияланған) мынадай өзгерістер енгізілсін:

тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларын бекіту туралы";

1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"1. Қоса беріліп отырған Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидалары бекітілсін.";

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларында:

тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидалары";

кіріспенің бірінші бөлімі мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидалары (бұдан әрі – Қағидалар) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі – Бағалы қағаздар нарығы туралы заң) сәйкес әзірленді және брокерлік және дилерлік қызметті (бұдан әрі – брокер және (немесе) дилер), инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті (бұдан әрі – Басқарушы) жүзеге асыруға лицензиясы бар ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру тәртібін белгілейді.";

1-қосымшаның жоғарғы оң жақ бұрышындағы мәтіні мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында
брокерлік және дилерлік
қызметті, инвестициялық
портфельді басқару
жөніндегі қызметті жүзеге
асыратын ұйымдар үшін
тәуекелдерді басқару
мен ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру
1-қосымша";

2-қосымша осы қаулының қосымшасына сәйкес редакцияда жазылсын;

3-қосымшаның жоғарғы оң жақ бұрышындағы мәтіні мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында
брокерлік және дилерлік
қызметті, инвестициялық
портфельді басқару
жөніндегі қызметті жүзеге
асыратын ұйымдар үшін
тәуекелдерді басқару
мен ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру
3-қосымша";

4-қосымшаның жоғарғы оң жақ бұрышындағы мәтіні мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында
брокерлік және дилерлік
қызметті, инвестициялық
портфельді басқару
жөніндегі қызметті жүзеге
асыратын ұйымдар үшін
тәуекелдерді басқару

мен ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру
4-қосымша";

5-қосымшаның жоғарғы оң жақ бұрышындағы мәтіні мынадай редакцияда жазылсын, орыс тіліндегі мәтіні өзгермейді:

"Бағалы қағаздар нарығында
брокерлік және дилерлік
қызметті, инвестициялық
портфельді басқару
жөніндегі қызметті жүзеге
асыратын ұйымдар үшін
тәуекелдерді басқару
мен ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру
5-қосымша".

2. Қаржы нарығының әдіснамасы департаменті (Әбдірахманов Н.А.) Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

1) Заң департаментімен (Сәрсенова Н.В.) бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

2) осы қаулы мемлекеттік тіркелген күннен бастап күнтізбелік он күн ішінде оның қазақ және орыс тілдеріндегі қағаз және электрондық түрдегі көшірмесін "Республикалық құқықтық ақпарат орталығы" шаруашылық жүргізу құқығындағы республикалық мемлекеттік кәсіпорнына Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде ресми жариялау және енгізу үшін жіберуді;

3) осы қаулыны ресми жарияланғаннан кейін Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды;

4) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін он жұмыс күні ішінде Заң департаментіне осы қаулының осы тармағының 2), 3) тармақшаларында және 3-тармағында көзделген іс-шаралардың орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

3. Қаржылық қызметтерді тұтынушылардың құқықтарын қорғау және сыртқы коммуникациялар басқармасы (Терентьев А.Л.) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін күнтізбелік он күн ішінде оның көшірмесін мерзімді баспасөз басылымдарында ресми жариялауға жіберуді қамтамасыз етсін.

4. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары О.А. Смоляковқа жүктелсін.

5. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі.

Ұлттық Банк
Төрағасы

Д. Ақышев

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2017 жылғы 22 желтоқсандағы

№ 257 қаулысына
қосымша
Бағалы қағаздар нарығында
брокерлік және дилерлік
қызметті, инвестициялық
портфельді басқару
жөніндегі қызметті жүзеге
асыратын ұйымдар үшін
тәуекелдерді басқару
мен ішкі бақылау жүйесін
қалыптастыру
2-қосымша
1-нысан

Баға тәуекелі бойынша стресс-тестинг

Актив санаты	Қаржы құралының ағымдағы құны (теңгемен)	Қаржы құралының ағымдағы құнының төмендеу сценарийі					Таңдалған сценарий бойынша шығын (теңгемен)
		0%-5%	5%-10%	10%-20%	20%-30%	30%-дан астам	
1	2	3	4	5	6	7	8
Шығын жиынтығы:							

1-бағанда нарықтық не бағалау бағасы бар активтер көрсетіледі. Бұл ретте Басқарушы немесе Басқарушы болып табылатын брокер және (немесе) дилер активтерді түрлері бойынша және экономика секторы бойынша дербес топтастырады.

3, 4, 5, 6, 7-бағандарда активтің әрбір санаты бойынша тек қана бір жорамалданған сценарий таңдалады.

Борыштық қаржы құралдары бойынша өтелуге тиіс кірістілік пайдаланылады.

Таңдалған сценарийдің қысқаша негіздемесі:

Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің бірінші басшысы (не оның орнындағы тұлға)

қолы

күні

2-нысан

Пайыздық тәуекел бойынша стресс-тестинг

--	--	--	--

Борыштық бағалы қағазды өтеуге дейінгі мерзім	Қаржы құралының ағымдағы құны	Купондық сыйақының пайыздық мөлшерлемесінің төмендеу сценарийі				Таңдалған сценарий бойынша шығын (теңгемен)
		0% - 2%	2% - 4%	4% - 6%	6%-дан астам	
1	2	3	4	5	6	7
6 айдан аз						
6-12 ай						
12-18 ай						
18-24 ай						
24 айдан астам						
Шығын жиынтығы:						

3, 4, 5, 6-бағандардағы бір санатты қаржы құралдары бірнеше сценарийге ұшырауы мүмкін.

Таңдалған сценарийдің қысқаша негіздемесі:

Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің бірінші басшысы (не оның орнындағы тұлға)

қолы

күні

3-нысан

Валюталық тәуекел бойынша стресс-тестинг

Шетел валютасы	Осы шетел валютасына номинирленген қаржы құралдарының ағымдағы құны (теңгемен)	Шетел валютасына қатысты теңгені нығайту сценарийі						Таңдалған сценарий бойынша шығын (теңгемен)
		1% - 3%	3% 5%	5% 7%	7%- 13%	13% - 20%	20%-дан астам	
Шығын жиынтығы:								

Таңдалған сценарийдің қысқаша негіздемесі:

Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің бірінші басшысы (не оның орнындағы тұлға)

қолы

күні

4-нысан

Өтімділік тәуекелі бойынша стресс-тестинг

--	--

Өтімді активтің атауы	Басқарушының инвестициялық қордың пайларын (акцияларын) осы инвестициялық қордың активтерінен пайыздық басқару арқылы сатып алуды жүзеге асыруына қажетті сома								
	0%-3%	3%-6%	6%-9%	9%-12%	12%-15%	15%-20%	20%-25%	25%-30%	30%-дан астам
Өтімді активтердің жеткіліктілігі									

Өтімділік тәуекелі бойынша стресс-тестинг Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің меншікті активтері бойынша жүзеге асырылады.

Басқарушының меншікті активтері бойынша өтімділік тәуекелі жөніндегі стресс-тестингті жүзеге асыру кезінде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 3 ақпандағы № 7 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 9410 болып тіркелген) бекітілген Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтің мәндерін есеп айырысу қағидаларында көзделген өтімді активтер тізбесі қолданылады.

Таңдалған сценарийдің қысқаша негіздемесі:

Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің бірінші басшысы (не оның орнындағы тұлға)

қолы

күні