

Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2018 жылғы 6 маусымда № 17005 болып тіркелді.

Ескерту. Қаулының тақырыбы жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабының 3-тармағына және "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

Ескерту. Кіріспе жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.12.2025 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

1. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін:

1) мынадай пруденциялық нормативтер белгіленсін:

мәні күн сайын кемінде 1 болатын меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті;

мәні күн сайын:

К2-1 – кемінде 1;

К2-2 – кемінде 0,9;

К2-3 – кемінде 0,8;

К2-4 – кемінде 0,5 болатын мерзімді өтімділік коэффициенті белгіленсін;

Бағалы қағаздар рыногы туралы заңның 63-бабының 1-тармағы төртінші бөлігінің 1), 2), 3) және 4) тармақшаларында көзделген банк операцияларының жекелеген түрлерін жүзеге асыруға лицензия алу мақсатында брокерлер және (немесе) дилерлер үшін:

жарғылық капиталдың ең төменгі мөлшері – кемінде 10 000 000 000 (он миллиард) теңге;

меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері – кемінде 10 000 000 000 (он миллиард) теңге.

Ескерту. 1-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 23.11.2022 № 106 (01.04.2023 қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

2. Мыналар бекітілсін:

осы қаулыға 1-қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары;

осы қаулыға 2-қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі.

Ескерту. 2-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

3. Осы қаулының қосымшасына сәйкес тізбе бойынша Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің, сондай-ақ Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілері құрылымдық элементтерінің күші жойылды деп танылсын.

4. Банктік емес қаржы ұйымдарын реттеу департаменті (Шайқақова Г.Ж.) 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 5-тармағында көзделген іс-шаралардың орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

5. 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.

6. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары Ж.Б. Құрмановқа жүктелсін.

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

Ұлттық Банк Төрағасы

Д. Ақышев

"КЕЛІСІЛДІ"

Қазақстан Республикасының

Ұлттық экономика министрлігі

Статистика комитетінің Төрағасы

Н. Айдапкелов

2018 жылғы 22 мамыр

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 80 қаулысына
1-қосымша

Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары

Ескерту. Қағида жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (қолданысқа енгізілу тәртібін 4-тармақтан қараңыз) қаулысымен.

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидалары (бұдан әрі - Қағидалар) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар нарығы туралы заң) 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес әзірленді және ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларын (бұдан әрі – ЕЖЗҚ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 1-ИПБ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және (немесе)

дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 2-ИПБ) қоса алғанда, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар (бұдан әрі – брокер және (немесе) дилер) сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

2. Қағидалар Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкімен жасалған активтерді инвестициялық басқару шартына сәйкес Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріне, Ұлттық почта операторына, ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларына, бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорының зейнетақы активтерін басқарушыларға қолданылмайды.

3. Брокердің және (немесе) дилердің, ЕЖЗҚ-ның, 1-ИПБ-дің, 2-ИПБ-нің үлестес тұлғалары бөлігінде Қағидаларда көзделген нормалар заңды тұлғаларға және олардың "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамының көрсетілген ұйымдардың дауыс беретін акцияларының жиырма бес және одан астам пайызын тікелей (банктер бойынша – жанама) иеленуі нәтижесінде брокермен және (немесе) дилермен, ЕЖЗҚ-мен, 1-ИПБ-мен, 2-ИПБ-мен үлестес болып табылатын үлестес тұлғаларына қолданылмайды.

4. Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшерін және операциялық тәуекелдің көрсеткіштерін есептеу мақсаты үшін тиісті қаржы жылына арналған республикалық бюджет туралы заңмен белгіленген айлық есептік көрсеткіш (бұдан әрі – АЕК) мөлшері қолданылады.

Ескерту. 4-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 23.11.2022 № 106 (01.04.2023 қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

5. Брокер және (немесе) дилер, ЕЖЗҚ, 1-ИПБ, 2-ИПБ пруденциялық нормативтерді бұзған жағдайда, бұзылған күннен 3 (үш) жұмыс күні ішінде тиісті пруденциялық нормативті бұзу фактісі және себептері туралы, оны жою бойынша іс-шаралар жоспарымен қоса қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті органға (бұдан әрі - уәкілетті орган) хабарлайды.

2-тарау. Пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібі

6. Брокер және (немесе) дилер, ЕЖЗҚ, 1-ИПБ, 2-ИПБ Қағидалардың қосымшасына сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі бойынша алдыңғы жұмыс күнінің соңындағы, сондай-ақ ағымдағы жұмыс күнінің тура алдындағы әрбір демалыс күндерінің соңындағы жағдай бойынша әрбір жұмыс күні пруденциялық нормативтері мәндерінің есебін жүргізеді.

7. Қағидалардың мақсаты үшін халықаралық қаржы ұйымдары деп мынадай ұйымдар түсініледі:

Азия даму банкі (the Asian Development Bank);

Америкааралық даму банкі (the Inter-American Development Bank);
Африка даму банкі (the African Development Bank);
Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank);
Еуропа қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development);
Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank);
Еуропалық Даму Банкінің Кеңесі (the Council of Europe Development Bank);
Жеке Секторды дамыту жөніндегі ислам корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);
Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank);
Инвестицияларды кепілдендіру жөніндегі көпжақты агенттік (the Multilateral Investment Guarantee Agency);
Скандинавия инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank);
Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund);
Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association);
Халықаралық есеп айырысу банкі (the Bank for International Settlements);
Инвестициялық дауларды реттеу жөніндегі халықаралық орталық (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);
Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development);
Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation);
Қара теңіз сауда және даму банкі (the Black Sea Trade and Development Bank).

Ескерту. 7-тармақ жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.12.2025 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

8. Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің рейтингтік бағаларынан басқа қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті орган (бұдан әрі – уәкілетті орган) сондай-ақ, Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 8318 болып тіркелген, "Болу қажеттілігі қаржы ұйымдарының, Қазақстан Республикасының бейрезиденті-банктері филиалдарының, Қазақстан Республикасының бейрезиденті-сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары филиалдарының қызметін реттейтін Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес талап етілетін заңды тұлғалар және елдер үшін ең төменгі рейтингіні, осы рейтингіні беретін рейтингтік агенттіктер тізбесін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2012 жылғы 24 желтоқсандағы № 385 қаулысымен белгіленген Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис), Fitch (Фич) агенттіктерінің және Қағидалардың 8-1-тармағында

белгіленген талап сақталған жағдайда, Қағидалардың 8-2-тармағында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктердің (бұдан әрі – басқа рейтингтік агенттіктер) бағаларын таниды.

Ескерту. 8-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

8-1. Пруденциялық нормативтерді есептеу кезінде Қағидалардың 8-2-тармағында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктер берген ұзақ мерзімді кредиттік рейтингтер халықаралық рейтингтік шкала бойынша тек рейтингтің шетелдік нысандарына қатысты пайдаланылады.

Ескерту. Қағида 8-1-тармақпен толықтырылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

8-2. Қағидалардың мақсаттары үшін уәкілетті орган мынадай өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктердің рейтингтік бағаларын таниды:

1) рейтингтік агенттік шығу елінде реттелуге жатады және рейтингтік агенттіктің бағалауы пруденциялық реттеу шеңберінде танылады;

2) рейтингтік агенттіктің меншікті капиталының ең аз мөлшері кемінде 600 000 000 (алты жүз миллион) теңгеге баламалы соманы құрайды;

3) объективтілік, тәуелсіздік және жауапкершілік:

рейтингтік агенттік қолданатын әдіснама сенімді болып табылады және дефолт туралы тарихи және (немесе) күтілетін деректер негізінде тексерілуге тиіс, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның өзіне қабылдаған қаржылық міндеттемелерін орындау қабілетін айқындайтын барлық негізгі сандық және сапалық факторлардың толық сипаттамасын, сондай-ақ олардың кредиттік рейтингтерге және кредиттік рейтингтер бойынша болжамдарға әсерін сипаттауды қамтиды;

рейтингтік агенттікті рейтингтік агенттіктің қызметіне араласпайтын және рейтингтерді беру процестеріне ықпалы жоқ мемлекеттік органдар немесе мемлекеттік органдардағы лауазымды адамдар, квазимемлекеттік сектор субъектілері немесе саяси партиялар бақыламайды;

рейтингтік агенттік акцияларының кемінде 10 (он) пайызын тікелей иеленетін және рейтингтік агенттіктің рейтингтік қызметіне ықпалы жоқ тұлғаларды қоспағанда, рейтингтік агенттік рейтинг беретін, растайтын немесе қайта қарайтын заңды тұлғалар рейтингтік агенттіктің үлестес тұлғалары болып табылмайды;

рейтингтік агенттіктің рейтингтік әрекеттерге қатысатын рейтингтік талдаушылары рейтингтік әрекеттерді жүзеге асыру күніне дейін соңғы 3 (үш) жыл ішінде рейтинг берілетін тұлғамен еңбек немесе іскерлік қатынастарда тұрмайды және тұрмаған, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның немесе рейтинг берілетін тұлғаны бақылауды жүзеге асыратын немесе осындай тұлғаға елеулі ықпал ететін тұлғалардың бағалы

қағаздарын, өзге де қаржы құралдарын немесе өзге де мүлкін тікелей немесе жанама, оның ішінде жақын туыстары арқылы иеленбейді;

рейтингтік агенттіктің ішкі аудит немесе ішкі бақылау, оның ішінде рейтингтік агенттіктің директорлар кеңесіне есеп беретін ішкі аудит функцияларын жүзеге асыратын қызметі бар;

рейтингтік агенттікте директорлар кеңесінің кемінде үштен бірі, бірақ кемінде екі мүшесі рейтингтік әрекеттерді, рейтингтік агенттіктің қызметтерін жарнамалауды және клиенттерді тарту жөніндегі өзге де іс-қимылдарды жүзеге асырмайтын тәуелсіз мүшелер болып табылады;

рейтингтік агенттіктің әрбір акционерінің акцияларын (жарғылық капиталға қатысу үлестерін) тікелей немесе жанама иелену үлесі осы рейтингтік агенттіктің дауыс беретін акцияларының жалпы санының 50 (елу) пайызынан аспайды, акционер қаржы ұйымы болып табылған жағдайда, тікелей иелену үлесі 10 (он) пайыздан аспайды;

рейтингтік агенттіктің ішкі рәсімдері ақпаратты заңсыз пайдаланудың және жария етудің алдын алу шараларын көздейді және ақпараттың қорғалуын және конфиденциалдылығын қамтамасыз етеді;

4) ақпараттың ашықтығы және оны жария ету:

рейтингтік агенттік рейтингтік агенттіктің интернет-ресурсында:

рейтингтік агенттік рейтингті айқындау кезінде қолданатын әдіснама;

соңғы жыл ішінде берілген кредиттік рейтингтердің, сондай-ақ соңғы аяқталған күнтізбелік жылдың соңындағы жағдай бойынша олардан түскен ақшалай түсімдердің үлесі рейтингтік агенттік түсімінің жылдық көлемінің бес және одан да көп пайызын құраған рейтинг берілетін тұлғалардың және өзге де тұлғалардың тізімі туралы ақпаратты жария етуді қамтамасыз етеді;

5) рейтингтердің сенімділігі:

рейтингтік агенттік рейтингтік қызметті кемінде соңғы 5 (бес) жыл тұрақты негізде жүзеге асырады;

рейтингтік агенттік кредиттік рейтингті берген және қайта қараған ұйымдар саны кемінде отыз, оның ішінде соңғы 3 (үш) жылда кемінде жиырма, оның ішінде кемінде бесеуі қаржы ұйымы болды;

рейтингтік агенттіктің рейтинг тағайындаумен тікелей айналысатын қызметкерлерінің тиісті білімі, дағдылары мен тәжірибесі бар;

рейтингтік шешім қабылдайтын органның (бұдан әрі – рейтингтік комитет) қатысушысы болып табылатын, рейтингтік шешімдер қабылдау процесіне қатысатын кемінде бір қызметкердің рейтингтік агенттікте не талдамалық агенттікте не зерттеу орталығында, не қаржы ұйымында, не аудиторлық ұйымда кемінде екі жыл жұмыс тәжірибесі бар;

рейтингтік комитеттің құрамында рейтинг берілетін тұлға және (немесе) оның қаржылық міндеттемелері немесе қаржы құралдары (бұдан әрі – рейтинг объектісі)

үшін жетекші рейтингтік талдаушыны, рейтингтік комитеттің төрағасын және қаралып отырған рейтинг объектісі жатпайтын, рейтинг объектілері түрінде маманданған бір рейтингтік талдаушыны қоса алғанда, кемінде бес рейтингтік талдаушы болады (егер рейтингтік агенттік рейтинг объектілерінің әр түріне қатысты рейтингтер беру жөніндегі қызметті жүзеге асырған жағдайда);

рейтингтік агенттік берілген рейтингтерді мониторингтеуді тұрақты негізде жүзеге асырады, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның қаржылық жағдайындағы, корпоративтік басқаруындағы немесе қызметінің өзге де аспектілеріндегі өзгерістерге, макроэкономикалық жағдайлардың немесе қаржы нарығы жағдайларының өзгеруіне байланысты өзгеретін факторларға уақтылы ден қоюды қамтамасыз етеді, бұл рейтинг берілген немесе ол соңғы қайта қаралған күннен немесе рейтингтік агенттік қолданылатын әдіснама соңғы қайта қаралған күннен бастап күнтізбелік 1 (бір) жылдан кешіктірілмей рейтингтердің нақты жаңартуларымен расталады.

Осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келген кезде рейтингтік агенттік уәкілетті органға рейтингтік агенттіктің осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемдерге сәйкес келуін растайтын құжаттарды қоса бере отырып, пруденциялық реттеу мақсаттары үшін рейтингтік агенттіктің рейтингтік бағаларын қабылдау туралы сұрау салуды жібереді.

Рейтингтік агенттік осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемдерге сәйкес келген кезде уәкілетті орган ресми интернет-ресурста рейтингтік агенттіктің оның рейтингтік бағаларын қабылдау туралы сұрау салуын алған күннен бастап 30 (отыз) жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде рейтингтік агенттік және рейтингтік агенттіктердің халықаралық рейтингтік шкалаларының салыстырмалылығы туралы мәліметтерді жариялайды.

Рейтингтік агенттік қолданатын әдіснамаларды уәкілетті орган рейтингтік агенттік уәкілетті органға алғаш рет жүгінген кезде және жылына кемінде 1 (бір) рет валидациялайды.

Рейтингтік агенттік қолданатын әдіснамаға өзгерістер енгізілген кезде рейтингтік агенттік 10 (он) жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде осындай өзгерістердің себептері мен салдарын көрсете отырып, ақпаратты уәкілетті органға жібереді.

Ескерту. Қағида 8-2-тармақпен толықтырылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі); жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 19.07.2024 № 40 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулыларымен.

9. Қағидалардың мақсаты үшін негізгі қор индекстері деп мынадай есептік көрсеткіштер (индекстер) түсініледі:

CAC 40 (Compagnie des Agents de Change 40 Index) (Компани дэ Эжон дэ Шанж 40 Индекс);
 DAX (Deutscher Aktienindex) (Дойтче Акциениндекс);
 DJIA (Dow Jones Industrial Average) (Доу Джонс Индастриал Эвередж);
 EURO STOXX 50 (EURO STOXX 50 Price Index) (Юроп Эс Ти Оу Экс Экс 50 Прайс Индекс);
 FTSE 100 (Financial Times Stock Exchange 100 Index) (Файнэншл Таймс Сток Эксчейндж 100 Индекс);
 HSI (Hang Seng Index) (Ханг Сенг Индекс);
 KASE (Kazakhstan Stock Exchange Index) (Казакстан Сток Эксчейндж Индекс);
 MSCI World Index (Morgan Stanley Capital International World Index) (Морган Стэнли Кэпитал Интернешнл Ворлд Индекс);
 MOEX Russia (Moscow Exchange Russia Index) (Москоу Эксчейндж Раша Индекс);
 NIKKEI 225 (Nikkei-225 Stock Average Index) (Никкэй-225 Сток Эвередж Индекс);
 RTSI (Russian Trade System Index) (Рашен Трейд Систем Индекс);
 S&P 500 (Standard and Poor's 500 Index) (Стандард энд Пурс 500 Индекс);
 TOPIX 100 (Tokyo Stock Price 100 Index) (Токио Сток Прайс 100 Индекс);
 NASDAQ-100 (Nasdaq-100 Index) (Насдак-100 Индекс).

Бағалы қағаздар нарығында
 брокерлік және (немесе)
 дилерлік қызметті жүзеге
 асыратын ұйымдар сақтауға
 міндетті пруденциялық
 нормативтердің мәндерін
 есептеу қағидаларына
 қосымша

Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі

Ескерту. Қосымша жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 16.05.2025 № 14 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

№	Көрсеткіштің атауы	Баланс бойынша сомасы	Есепке алынатын көлемі (пайызбен)	Есептеу сомасы
1	2	3	4	5
1	Ақша және салымдардың барлығы, оның ішінде:			
1.1	Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан		100	

	аспайтын сомадағы кассадағы ақша			
1.2	осы қосымшаның 1.9 және 1.10-жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша		100	
1.3	осы қосымшаның 1.11-жолында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша		90	
1.4	қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша		100	
1.5	Ұйымның клиринг ұйымының (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарналар, маржалық жарналар, қор биржасының сауда жүйесінде ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз		100	

	ету болып табылатын ақшасы			
1.6	Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банкте ріндегі ағымдағы шоттардағы ақша		100	
1.7	"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша		100	
	бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың			

1.8	<p>мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы ақша (International Securities Services Association) (Интернэшнл Секьюритис Сервисис Асошиайшн)</p>		100	
1.9	<p>Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар</p>		100	
	<p>мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар: Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard &</p>			

1.10	<p>Roog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB+"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар;</p> <p>Қазақстан Республикасының бейрезидент-бас банктері Standard & Poog's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "А-"-тен төмен емес шетел валютасында ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады</p>	100		
1.11	<p>Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-дан "kzBB-"-ға</p>	90		

	дейін рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар			
1.12	Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің "AA"-тен төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қ а р ж ы ұйымдарындағы салымдар, Еуразия даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұ л т т ы қ валютасындағы салымдар		100	
1.13	Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тен төмен емес ұзақ мерзімді немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі б а р бейрезидент-банктердегі салымдар		100	
2	Борыштық бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде:			
	Қазақстан Республикасының			

2.1	Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған, басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары		100	
2.2	қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар		100	
2.3	акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік қызметпен байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар		100	
2.4	Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес "Қазақстан Даму банкі", "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі", "		100	

	Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар			
2.5	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, немесе қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		90	
	сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналдық			

2.6	<p>құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін, "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстан Даму банкі" акционерлік қоғамының кепілдіктері бар, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" не "Баламалы" алаңдары "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексі не сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар</p>		95	
2.7	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "</p>		60	

	<p>борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>			
2.8	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poog's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poog's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzA-"-тен төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар (эмитентінің рейтингі бар) Қазақстан</p>		100	

	<p>Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>			
2.9	<p>Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " В+ "-тен "В "-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша " kzBBB+ "-тен "kzBB "-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p>		85	
	<p>Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "AA "- тен төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі</p>			

2.10	бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразия Даму Банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген бағалы қағаздар		100	
2.11	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		100	
2.12	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		90	
	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейін тәуелсіз			

2.13	рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары	80	
2.14	Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	100	
2.15	Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	85	
2.16	Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің	70	

	бірінің рейтингі (эмитентінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары			
3	Акциялар және депозитарлық қолхаттар – барлығы, оның ішінде:			
3.1	Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		100	
3.2	заңды тұлғалардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		100	
	Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "стандарт" санатына енгізілген			

3.3	<p>акциялары немесе Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, жария сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттарды қоспағанда, базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p>	80		
3.4	<p>Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін, жария сауда-саттыққа жіберілген қор биржасының "Өңірлік акциялар нарығының сегменті" ресми</p>	60		

	тізімінің кіші бөліміне енгізілген акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар			
3.5	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		100	
3.6	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын		80	

	депозитарлық қолхаттар			
3.7	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		60	
4	Өзге бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде:			
4.1	инвестициялық қорлардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген бағалы қағаздары		70	
4.2	активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэйдэд Фандс) пайлары		90	
	Morningstar рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар			

4.3	Exchange Traded Funds (ETF) (Экстейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (ETC) (Экстейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Экстейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары		80	
4.4	орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар		100	
4.5	активтерінің құрамы Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, тек қана мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар есебінен қалыптастырылған, олар бойынша "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдігі бар, сомасы қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын		95	

	өтейтін инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары			
5	Өзге активтер – барлығы, оның ішінде:			
5.1	тазартылған бағалы металдар және металл шоттар		100	
5.2	бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (Ұйымның үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада		100	
5.3	бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің өтуіне байланысты туындаған (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің талаптары бойынша мерзімі өтпеген) бағалы қағаздардың номиналдық құнын төлеуге қойылатын талаптар		100	
	Ұйымның балансы бойынша активтер			

5.4	сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі Ұйымның негізгі құралдары		100	
6	Жиынтық өтімді активтер			
6.1	Өтімді активтер			
6.2	Өтімділігі жоғары активтер			
6.3	" Р е п о " операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар (мемлекеттік бағалы қағаздарды қоспағанда)		70	
6.4	" Р е п о " операцияларының нысанасы болып табылатын, өтеу мерзімі есептік күнге дейін 1 (бір) жылға дейін өтеу мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар		95	
6.5	" Р е п о " операцияларының нысанасы болып табылатын, өтеу мерзімі есептік күнге дейін 1 (бір) жылдан астам өтеу мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар		85	
7	Баланс бойынша жиынтық міндеттемелер, соның ішінде:			
7.1	7 күнге дейін			
7.2	30 күнге дейін			
7.3	90 күнге дейін			
7.4	Маржалық қамтамасыз ету бойынша міндеттемелер			

8	Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері			
8.1	ИПБ_От			
8.2	БД_От			
8.3	ЗА_ИПБ_От			
9	Меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициенті			
10	Мерзімді өтімділік коэффициенті:			
10.1	К2-1			
10.2	К2-2			
10.3	К2-3			
10.4	К2-4			

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 80 қаулысына
2-қосымша

Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

Ескерту. 2-қосымшамен толықтырылды – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (қолданысқа енгізілу тәртібін 4-тармақтан қараңыз); жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 27.11.2023 № 87 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулыларымен.

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі (бұдан әрі – Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабына сәйкес әзірленді және ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларын (бұдан әрі – ЕЖЗҚ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін

номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 1-ИПБ), ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару қызметін клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушыларды (бұдан әрі – 2-ИПБ) қоса алғанда, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар (бұдан әрі – брокер және (немесе) дилер) сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

2-тарау. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

2. Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшерін есептеу мақсаттары үшін тиісті қаржы жылына арналған республикалық бюджет туралы заңда белгіленген айлық есептік көрсеткіштің (бұдан әрі - АЕК) мөлшері пайдаланылады.

3. Брокер және (немесе) дилердің меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$$K = (\Theta\text{ЖА} + \Theta\text{А} - M) / (M\text{КАМ} + B\text{Д_От}), \text{ мұндағы:}$$

$\Theta\text{ЖА}$ - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімділігі жоғары активтері;

$\Theta\text{А}$ - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері;

M - есеп айырысу күніне қолда бар, баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

$M\text{КАМ}$ - меншікті капиталдың брокердің және (немесе) дилердің меншікті капиталының жеткіліктілігі есебіне алынатын ең аз мөлшері:

Номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы бар брокердің және (немесе) дилердің $M\text{КАМ}$ 50 000 (елу мың) АЕК-ті;

Клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы жоқ брокердің және (немесе) дилердің $M\text{КАМ}$, 10 000 (он мың) АЕК-ті құрайды;

$B\text{Д_От}$ - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел.

4. Брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел төмендегідей есептеледі:

$$B\text{Д_От} = \text{абсолютті көрсеткіш} + a * \text{салыстырмалы көрсеткіш}, \text{ мұнда:}$$

абсолюттік көрсеткіш 15 000 (он бес мың) АЕК-ке тең;

салыстырмалы көрсеткіш есепті күннің алдындағы соңғы 60 (алпыс) айдағы пайда мен шығындар туралы есептің айыпақы (айыппұл, өсімпұл) бабы бойынша орташа жылдық шығыстың 15 (он бес) еселенген мөлшері ретінде есептеледі;

а - операциялық тәуекелдің коэффициенті есептік күннің алдындағы соңғы 36 (отыз алты) айда брокерлер және (немесе) дилерлер жасасқан мәмілелердің* орташа жылдық көлеміне байланысты белгіленген және кестеге сәйкес айқындалады:

Санаты	Мәмілелердің орташа жылдық көлемі (3 жыл) (теңге)	Коэффициент, а
1	1000 млрд-қа дейін	1
2	1000 млрд-тан 3000 млрд-қа дейін	2
3	3000 млрд-тан 5000 млрд-қа дейін	3
4	5000 млрд-тан 7500 млрд-қа дейін	5
5	7500 млрд-тан жоғары	7

*бағалы қағаздардың ұйымдастырылған, ұйымдастырылмаған және халықаралық нарықтарында, сондай-ақ "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында (брокер және (немесе) дилер номиналды ұстаушы болған кезден басқа), валюта нарығында (банк операцияларының жекелеген түрлерін жүзеге асыратын ұйымдар үшін) жасалған мәмілелер, сондай-ақ репо ашу, "кері репо" операцияларының көлемі.

Бұл ретте, егер брокер және (немесе) дилер лицензияны алған сәттен бері мерзім жоғарыда көрсетілген мерзімнен аз кезеңді құрайтын болса, онда бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға арналған лицензияны алған сәттен бастап деректер пайдаланылады.

Бұл ретте, егер салыстырмалы көрсеткіштің мәні 3 000 (үш мың) АЕК-тен аз болса, онда салыстырмалы көрсеткіштің мәні 3 000 (үш мың) АЕК-ке тең болады.

Жасалатын мәмілелер болмаған кезде а 0-ге (нөл) тең.

Бағалы қағаздар рыногы туралы заңның 53-2-бабының 5-тармағында белгіленген жағдайларды қамтитын клиенттер алдындағы жауапкершілікті сақтандыру кезінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы жоқ брокер және (немесе) дилер абсолюттік көрсеткіштің мөлшерін сақтандыру сомасының мөлшеріне азайтады, бірақ ол абсолюттік көрсеткіш мөлшерінің 50%-нан аспауға тиіс.

5. Брокердің және (немесе) дилердің мерзімді өтімділік коэффициенттерінің ең аз мәні мынадай мөлшерде белгіленеді:

К2-1 – кемінде 1;

К2-2 – кемінде 0,9;

К2-3 – кемінде 0,8;

К2-4 – кемінде 0,5.

К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті 0 (нөл) күннен 7 (жеті) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен өтімділігі жоғары активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 7 (жеті) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері өтімділігі жоғары активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті 0 (нөл) күннен 30 (отыз) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейін қалған мерзімімен жиынтық өтімді активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 30 (отыз) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті 0 (нөл) күннен 90 (тоқсан) күнге дейін қоса алғанда, өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен жиынтық өтімді активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 90 (тоқсан) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімі міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті жиынтық өтімді активтер мөлшерінің жиынтық міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер жиынтық міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

Брокердің және (немесе) дилердің есеп айырысу күнгі өтімділігі жоғары және өтімді активтері Әдістеменің 6-тармағына сәйкес осындай деп танылады.

6. Брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның жоғары өтімді активтерін есептеу кезінде осы қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына (бұдан әрі – Қағидалар) қосымшаға сәйкес пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінің келесі жолдарында көрсетілген активтер тиісті көлемдерде ескеріледі:

1.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4 (репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

Брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері ретінде Қағидаларға қосымшаға сәйкес пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінің келесі жолдарында көрсетілген активтер тиісті көлемдерде танылады:

1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5 (репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

Брокер және (немесе) дилер әрбір эмитентке және оның аффилиирленген тұлғаларына салынған инвестициялар көлемі брокердің және (немесе) дилердің жиынтық өтімді активтерінің 20 пайызынан аспауын көздейтін әртараптандыру нормативін сақтауға міндетті.

Осы Әдістеменің үшінші бөлігінде белгіленген норма Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына, сондай-ақ бір-біріне қатысты аффилиирленген тұлғалар болып табылатын, дауыс беретін акцияларының елу (елу) пайызынан астамы

мемлекетке, ұлттық басқарушы холдингке немесе Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі тұлғалар шығарған (ұсынған) қаржы құралдарына қолданылмайды.

Сондай-ақ орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарға да қолданылмайды.

Ескерту. 6-тармақ жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.04.2026 № 79 (алғаш ресми жарияланған күнінен бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

7. Әдістеменің 6-тармағында көзделген өтімділігі жоғары және өтімді активтердің есебіне мыналар енгізілмейді:

1) брокердің және (немесе) дилердің міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) брокердің және (немесе) дилердің меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемдерде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

Репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 70%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 85%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 95%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 6.3, 6.4, 6.5-жолдарында көрсетіледі.

2) өлшемдері қор биржасы акциялар нарығының индексін (қор биржасының өкілдік тізімі) есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, брокерге және (немесе) дилерге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар жатады.

Ескерту. 7-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 16.05.2025 № 14 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

3-тарау. Ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі

8. ЕЖЗҚ меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$K = (\Theta A - M) / MKAM$, мұнда:

ΘA - Әдістеменің 11-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

M - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

$MKAM$ - Әдістеменің 10-тармағына сәйкес есептелген, меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын ЕЖЗҚ меншікті капиталының ең аз мөлшері.

9. ЕЖЗҚ өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$\Theta_k = \Theta A / M$, мұнда:

ΘA - Әдістеменің 11-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

M - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

10. Егер:

инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден кем болса, онда $MKAM$ 107 000 (жүз жеті мың) АЕК-ке тең ;

инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден асатын болса, онда $MKAM$ 107 000 (жүз жеті мың) АЕК + (АПУ- 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)* 0,0001, мұнда АПУ инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтері болып табылады.

11. Қағидалардың қосымшасына сәйкес тиісті көлемдерде Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген ЕЖЗҚ-ның меншікті активтері ЕЖЗҚ-ның өтімді активтері деп танылады.

12. Әдістеменің 11-тармағында көзделген өтімді активтердің есебіне енгізілмейді:

1) ЕЖЗҚ міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) ЕЖЗҚ-ның меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздар Қағидалардың қосымшасына сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде ЕЖЗҚ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздар ЕЖЗҚ-ның өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) ЕЖЗҚ-ға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар;

3) ЕЖЗҚ-ның ірі акционерлеріне және осы сенімгерлік басқарушылардың үлестес тұлғаларына тиесілі ЕЖЗҚ-ның дауыс беретін акцияларының он және одан да көп пайызымен сенімгерлік басқарушылар шығарған бағалы қағаздар;

4) ЕЖЗҚ-ға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын екінші деңгейдегі банктердегі салымдар мен ағымдағы шоттар.

13. ЕЖЗҚ-ның меншікті активтері есебінен мәмілелер Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 32832 болып тіркелген, Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2023 жылғы 7 маусымдағы № 42 қаулысымен бекітілген Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорының және (немесе) ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларының қызметін жүзеге асыру қағидаларының 2-тарауында белгіленген тәртіппен жасалады.

4-тарау. Ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушылардың немесе ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығынсыз инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен қоса атқаратын инвестициялық портфельді басқарушылардың пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі

14. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$$K = (\Theta\text{ЖА} + \Theta\text{А} - M) / (M\text{КАМ} + B\text{Д}_\text{От} + \text{ИПБ}_\text{От} + 3\text{А}_\text{ИПБ}_\text{От}), \text{ мұнда:}$$

ӨЖА - Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын есептеу күніне қолда бар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер:

МКАМ - бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын, 440 000 (төрт жүз қырық мың) АЕК-ті құрайтын меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының ең төмен мөлшері;

БД_От - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел;

ИПБ_От - есепті күнге инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 0,1%;

ЗА_ИПБ_От - зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел, инвестициялық басқарудағы активтердің есептеу күніндегі мөлшері ретінде есептелген, ЗА УИП операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген – 4%.

15. 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншік капиталының жеткіліктілік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$K = (\text{ӨЖА} + \text{ӨА} - \text{М}) / (\text{МКАМ} + \text{БД_От} + \text{ИПБ_От})$, мұнда:

ӨЖА - Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын есептеу күніне қолда бар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 17-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

МКАМ - меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын, 50 000 (елу мың) АЕК-ті құрайтын 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншікті капиталының ең аз мөлшері;

БД_От - Әдістеменің 4-тармағына сәйкес есептелген брокерлік және (немесе) дилерлік қызметпен байланысты операциялық тәуекел;

ИПБ_От – есепті күнге инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 0,1%.

16. 1-ИПБ немесе 2-ИПБ мерзімді өтімділік коэффициенттерінің ең төменгі мәні мынадай мөлшерде белгіленеді:

К2-1 – кемінде 1;

К2-2 – кемінде 0,9;

К2-3 – кемінде 0,8;

К2-4 – кемінде 0,5.

К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті 0-ден (нөлден) 7 (жеті) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне

жоғары өтімді активтердің мөлшерінің қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0-ден (нөлден) 7 (жеті) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жоғары өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті 0-ден (нөлден) 30 (отыз) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне жиынтықты өтімді активтердің мөлшерінің қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0-ден (нөлден) 30 (отыз) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жиынтықты өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті 0-ден (нөлден) 90 (тоқсан) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне жиынтықты өтімді активтердің мөлшерінің қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0-ден (нөлден) 90 (тоқсан) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жиынтықты өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті жиынтықты міндеттемелердің мөлшеріне жиынтықты өтімді активтердің мөлшерінің қатынасы ретінде есептеледі. Егер жиынтықты міндеттемелердің мөлшері жиынтықты өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

Инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күніне қолда бар жоғары өтімді және өтімді активтері Әдістеменің 17-тармағына сәйкес сондай деп танылады.

17. 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімділігі жоғары активтер есебіне Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген, 1.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4 (репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) тиісті көлемдегі активтер кіреді.

Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген 1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5 (репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) тиісті көлемдегі активтер 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері ретінде танылады.

1-ИПБ немесе 2-ИПБ әртараптандыру нормативін сақтайды, бұл ретте бір эмитентке және оның үлестес тұлғаларына инвестициялар көлемі 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жиынтық өтімді активтерінің 20%-нан аспайды.

Әдістеменің осы тармағының үшінші бөлігінде белгіленген норма дауыс беретін акцияларының 50 (елу) пайызынан астамы мемлекетке немесе ұлттық басқарушы холдингке немесе Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, бір-біріне қатысты үлестес болып табылатын тұлғалар шығарған (ұсынған) қаржы құралдарына, сондай-ақ орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарға қатысты қолданылмайды.

Ескерту. 17-тармақ жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.12.2025 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

18. Әдістеменің 17-тармағында көзделген 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жоғары өтімді және өтімді активтерінің есебіне мыналар енгізілмейді:

1) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды есепке алмағанда) Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 70%-ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 85% -ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 95% -ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес 1-ИПБ немесе 2-ИПБ пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 6.3, 6.4, 6.5-жолында көрсетіледі.

2) өлшемдері қор биржасының акциялар нарығының индексін есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, 1-ИПБ немесе 2-ИПБ-ге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар (қор биржасының өкілдік тізімі).

Ескерту. 18-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 16.05.2025 № 14 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 80 қаулысына
қосымша

Күші жойылды деп танылатын Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің, сондай-ақ Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілерінің құрылымдық элементтерінің тізбесі

1. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативті белгілеу, Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтің мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 16 шілдедегі № 146 қаулысы (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 9736 болып тіркелген, 2014 жылғы 2 қазанда "Заң газеті" газетінде № 148 (2542) жарияланған).

2. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне қор биржасы бағалы қағаздарының ресми тізімі мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 24 желтоқсандағы № 244 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 10339 болып тіркелген, 2015 жылғы 18 наурызда "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде жарияланған) бекітілген Қор биржасы бағалы қағаздарының ресми тізімі мәселелері бойынша Қазақстан Республикасының өзгерістер енгізілетін нормативтік құқықтық актілерінің тізбесінің 18-тармағы.

3. "Эмитенттерге және олардың қор биржасында айналысқа жіберілетін (жіберілген) бағалы қағаздарына, сондай-ақ қор биржасы тізімінің жекелеген санаттарына қойлатын талаптарды бекіту және Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығын реттеу мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 27 наурыздағы № 54 қаулысының (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 15175 болып тіркелген, 2017 жылғы 14 маусымда Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде

жарияланған) 2-қосымшасына сәйкес Өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесінің 13-тармағы.

4. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың есептілікті ұсыну мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 29 қаңтардағы № 5 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 16498 болып тіркелген, 2018 жылғы 19 наурызда 2018 года Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде жарияланған) бекітілген Бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың есептілікті ұсыну мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерінің тізбесінің 3-тармағы.