

Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне пруденциялық реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2021 жылғы 20 қыркүйектегі № 89 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2021 жылғы 23 қыркүйекте № 24484 болып тіркелді.

"Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 42-бабы 1-1-тармағының бірінші бөлігіне және 3-тармағына, "Жылжымайтын мүлік ипотекасы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 5-3-бабы 1-тармағының 3) тармақшасына, "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 9-бабы 1-тармағының 5) тармақшасына және 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес Өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін Қазақстан Республикасының пруденциялық реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі (бұдан әрі - Тізбе) бекітілсін.

2. Қаржы ұйымдарының әдіснамасы және пруденциялық реттеу департаменті Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

1) Заң департаментімен бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

2) осы қаулыны ресми жарияланғаннан кейін Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды;

3) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін он жұмыс күні ішінде Заң департаментіне осы тармақтың 2) тармақшасында көзделген іс-шараның орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

3. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Төрағасының жетекшілік ететін орынбасарына жүктелсін.

4. Осы қаулы 2021 жылғы 1 қазаннан бастап қолданысқа енгізілетін Тізбеге 3-қосымшаның 4.4-жолын, 4-қосымшаның 9-тармағының үшінші және төртінші абзацтарын, 5-қосымшаның 4.4-жолын, 6-қосымшаның 5-тармағының үшінші және төртінші абзацтарын, 10-тармағының үшінші және төртінші абзацтарын, 16-тармағының үшінші және төртінші абзацтарын қоспағанда, алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі.

"КЕЛІСІЛДІ"

"КЕЛІСІЛДІ"

Қазақстан Республикасының
Қаржы нарығын реттеу және
дамыту

Агенттігінің Басқармасының
2021 жылғы 20 қыркүйектегі
№ 89 Қаулыға қосымша

Өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін Қазақстан Республикасының пруденциялық реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі

1. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 28.04.2026 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

2. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 28.04.2026 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

3. "Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің, сондай-ақ олардың мәнінің сақталуын сипаттайтын көрсеткіштердің түрлерін белгілеу, Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 79 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген) мынадай өзгерістер мен толықтыру енгізілсін:

тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын:

"Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы";

кіріспесі мынадай редакцияда жазылсын:

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабының 9-3) тармақшасына және "Мемлекеттік статистика туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 16-бабы 3-

тармағының 2) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ**:";

1 және 2-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

"1. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің мынадай түрлері:

мәні күн сайын кемінде 1 болатын меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті;

мәні күн сайын кемінде 1,4 болатын өтімділік коэффициенті белгіленсін.

2. Мыналар бекітілсін:

1) осы қаулыға 1-қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары;

2) осы қаулыға 2-қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі.";

Көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары Тізбеге 3-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

Тізбеге 4-қосымшаға сәйкес редакцияда 2-қосымшамен толықтырылсын.

4. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің, сондай-ақ олардың мәнінің сақталуын сипаттайтын көрсеткіштердің түрлерін белгілеу, Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17005 болып тіркелген) мынадай өзгерістер және толықтыру енгізілсін:

тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын:

"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";

кіріспесі мынадай редакцияда жазылсын:

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы 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 және "Мемлекеттік статистика

туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 16-бабы 3-тармағының 2) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ**:";

1 және 2-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

"1. Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін мынадай пруденциялық нормативтер белгіленсін:

меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициентінің мәні күн сайын кемінде 1 болады;

өтімділік коэффициентінің мәні күн сайын кемінде 1,4 болады.

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.

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.";

Көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары Тізбеге 5-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

Тізбеге 6-қосымшаға сәйкес редакцияда 2-қосымшамен толықтырылсын."

Өзгерістер мен толықтырулар
енгізілетін Қазақстан
Республикасының
пруденциялық реттеу мәселелері
бойынша нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
1-қосымша

Ескерту. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 28.04.2026 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

Өзгерістер мен толықтырулар
енгізілетін
Қазақстан Республикасының
пруденциялық реттеу мәселелері

бойынша нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
2-қосымша

Ескерту. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 28.04.2026 № 85 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

Өзгерістер мен толықтырулар
енгізілетін

Қазақстан Республикасының
пруденциялық реттеу мәселелері
бойынша нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
3-қосымша

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

Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидалары 1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауы міндетті пруденциялық нормативтерді есептеу әдістемесі (бұдан әрі - Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы (бұдан әрі- Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" 2003 жылғы 4 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес әзірленді және инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың (бұдан әрі-инвестициялық портфельді басқарушылар) сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

2-тарау. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу тәртібі

2. Инвестициялық портфельді басқарушылар Қағидалардың қосымшасына сәйкес "Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндері есебінің" кестесі бойынша алдыңғы жұмыс күнінің соңындағы, сондай-ақ ағымдағы жұмыс күнінің тура алдындағы әрбір демалыс күндерінің соңындағы жағдай бойынша әрбір жұмыс күні инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндерінің есебін жүргізеді.

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

Азиялық даму банкі (Asian Development Bank);

Америкааралық даму банкі (Inter-American Development Bank);

Африкалық даму банкі (African Development Bank);

Еуразия даму банкі (Eurasian Development Bank);

Еуропа қайта құру және даму банкі (European Bank for Reconstruction and Development);

Еуропа инвестициялық банкі (European Investment Bank);

Еуропа Кеңесінің Даму Банкі (the Council of Europe Development Bank);

Жеке секторды дамыту жөніндегі исламдық корпорация (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);

Ислам даму банкі (Islamic Development Bank);

Жан-жақты инвестицияларға кепілдік беру агенттігі (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 (International Bank for Reconstruction and Development);

Халықаралық қаржы корпорациясы (International Finance Corporation).

4. Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті орган (бұдан әрі - уәкілетті орган) Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің рейтингтік бағаларынан басқа 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 бекітілген Moody's Investors Service және Fitch (Мудис Инвесторс Сервис және Фич) агенттіктерінің (бұдан әрі - басқа рейтингтік агенттіктер) рейтингтік бағаларын да таниды.

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

SAC 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).

6. Қағидалар ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығы бар инвестициялық портфельді басқарушыларға және "өмірді сақтандыру" саласында қызметті жүзеге асыратын, бағалы қағаздар нарығында инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға лицензиясы бар сақтандыру ұйымдарына қолданылмайды.

7. Сенімгерлікпен басқаруға берілген Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің алтынвалюта активтері және Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтері инвестициялық портфельді басқарушылардың пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кезінде есепке алынбайды.

8. Қағидалардың инвестициялық портфельді басқарушының үлестес тұлғалары бөлігінде көзделген нормалары заңды тұлғаларға және олардың "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамының көрсетілген ұйымдардың дауыс беретін акцияларының жиырма бес және одан артық пайызын тікелей (банктер бойынша – жанама) иеленуі нәтижесінде инвестициялық портфельді басқарушымен үлестес болып табылатын үлестес тұлғаларына қолданылмайды.

9. Инвестициялық портфельді басқарушы бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті қоса атқарған жағдайда, Бағалы қағаздар рыногы туралы заңның 49-бабының 3-тармағына сәйкес уәкілетті органның нормативтік құқықтық актісімен бекітілген, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібі ескеріле отырып есептеледі.

10. Меншікті капитал жеткіліктілігінің коэффициенті және (немесе) өтімділік коэффициенті бұзылған жағдайда инвестициялық портфельді басқарушы бұзылған күннен бастап 3 (үш) жұмыс күні ішінде тиісті пруденциялық нормативті бұзу фактісі

және себептері туралы, оны жою бойынша іс-шаралар жоспарымен қоса уәкілетті органға хабарлайды.

Инвестициялық портфельді
басқаруды жүзеге асыратын
ұйымдар сақтауға міндетті
пруденциалық нормативтердің
мәндерін есеп айырысу
қағидаларына
қосымша

Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциалық нормативтерінің мәнін есептеу кестесі

| № | Көрсеткіш атауы | Баланс бойынша сомасы | Ескерілетін көлем (пайызбен) | Есептелетін сома | Ескерту |
|-----|---|-----------------------|-------------------------------|------------------|---------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | |
| 1 | Ақша және салымдар - барлығы, оның ішінде: | | | | |
| 1.1 | инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада кассадағы ақша | | 100 | | |
| 1.2 | о с ы Қосымшаның 1.9 және 1.10-жолдарында көрсетілген, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша | | 100 | | |
| 1.3 | о с ы Қосымшаның 1.11-жолында көрсетілген, Қазақстан Республикасының екінші | | 90 | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| | деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша | | | | |
| 1.4 | орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша | | 100 | | |
| 1.5 | клирингтік ұйымның (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарна, маржа салымдары, ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен қор биржасының сауда-саттық жүйесінде жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын инвестициялық портфельді басқарушының ақшасы | | 100 | | |
| 1.6 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік | | 100 | | |

| | | | | | |
|-----|--|-----|--|--|--|
| | <p>агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша</p> | | | | |
| 1.7 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB" төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар, "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасы Заңының 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын Қазақстан Республикасының бейрезидент ұйымдарындағы шоттардағы ақша</p> | 100 | | | |
| | <p>Бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып</p> | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| 1.8 | табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) | | 100 | | |
| 1.9 | осы банктер қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізімінде болатын эмитенттер болған жағдайда, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар | | 100 | | |
| | мына талаптардың біріне сәйкес келетін Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар: Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B"-дан төмен емес ұзақ мерзімді | | | | |

| | | | | |
|------|---|-----|--|--|
| 1.10 | <p>кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандарт 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; Қазақстан Республикасының резидент еншілес банктері, олардың бас банктері шетел валютасында Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "A"-тан төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар, Қазақстан Республикасының бейрезиденті болып табылады.</p> | 100 | | |
| | Standard & Poor's (Стандарт | | | |

| | | | | | |
|------|---|-----|--|--|--|
| 1.11 | <p>энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-ден "kzBB"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар</p> | 90 | | | |
| 1.12 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "AA"-тан төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдарындағы салымдар, Еуразиялық</p> | 100 | | | |

| | | | | | |
|------|---|--|-----|--|---|
| | Даму Банкіндегі Қазақстан Республикасының ұлттық валютасындағы салымдар | | | | |
| 1.13 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тан төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар бейрезидент банктердегі салымдар | | 100 | | |
| 2 | Борыштық бағалы қағаздар - барлығы, оның ішінде: | | | | 2021 жылғы 1 қазаннан бастап борыштық бағалы қағаздардың құрамында орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын борыштық бағалы қағаздар есепке алынбайды |
| 2.1 | басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес айналысқа шығарылғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен | | 100 | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| | Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары | | | | |
| 2.2 | Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған, Қазақстан Республикасының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген борыштық бағалы қағаздар | | 100 | | |
| 2.3 | акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік қызметке байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар | | 100 | | |
| | Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес " Қазақстанның Даму Банкі", " Самұрық-Қазына" ұлттық | | | | |

| | | | | |
|-----|---|-----|--|--|
| 2.4 | <p>әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі, " Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар</p> | 100 | | |
| 2.5 | <p>Қазақстан Республикасын ың және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің " Негізгі" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген Қазақстан Республикасы з а н д ы тұлғаларының мемлекеттік емес бағалы қағаздары немесе қор биржасының " Негізгі" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарын қанағаттандырат ын "Астана" халықаралық қ а р ж ы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында а ш ы қ сауда-саттыққа</p> | 90 | | |

| | | | | | |
|-----|---|----|--|--|--|
| | <p>жіберілген Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | | | | |
| 2.6 | <p>Қазақстан Республикасын ың және басқа мемлекеттердің заңнамасына с ә й к е с шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің " Балама " алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының " Балама " алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарын қанағаттандырат ын "Астана" халықаралық қ а р ж ы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында а ш ы қ сауда-саттыққа жіберілген Қазақстан</p> | 60 | | | |

| | | | | | |
|-----|--|-----|--|--|--|
| | Республикасы з а н д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары | | | | |
| 2.7 | Қазақстан Республикасын ың және басқа мемлекеттердің заңнамасына с ә й к е с шығарылған, (эмитентте) Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-"- тан төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар немесе Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzA-" -тан төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы з а н д ы тұлғаларының мемлекеттік емес бағалы қағаздары | 100 | | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|-----|--|----|--|--|
| 2.8 | <p>Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, (эмитентте) Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB-"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | 85 | | |
| | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "AA | | | |

| | | | | | |
|------|---|-----|--|--|--|
| 2.9 | <p>" төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразиялық Даму Банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген бағалы қағаздар</p> | 100 | | | |
| 2.10 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары</p> | 100 | | | |
| | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейінгі тәуелсіз</p> | | | | |

| | | | | | |
|------|--|-----|--|--|--|
| 2.11 | рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары | 90 | | | |
| 2.12 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейінгі тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары | 80 | | | |
| 2.13 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша (эмитенттің) "BBB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т елдік эмитенттердің мемлекеттік | 100 | | | |

| | | | | | |
|------|---|--|----|--|--|
| | емес борыштық бағалы қағаздары | | | | |
| 2.14 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша (эмитенттің) "BB+"-тен "BB-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары | | 85 | | |
| 2.15 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша (эмитенттің) "B+"-тен "B-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары | | 70 | | |
| | | | | | 2021 жылғы 1 қазаннан бастап акциялар мен депозитарлық |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| 3 | Акциялар және депозитарлық қолхаттар - барлығы, оның ішінде: | | | | қолхаттардың құрамында орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттар есепке алынбайды |
| 3.1 | негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | 100 | | |
| 3.2 | қор биржасының ресми тізіміне "Негізгі" алаңының "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін, қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлғалардың акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | 100 | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|-----|---|----|--|--|
| 3.3 | <p>қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "стандарт" санатына енгізілген Қазақстан Республикасының резидент заңды тұлғаларының акциялары немесе осы Қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген акциялар және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттарды санамағанда, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, ашық сауда-саттыққа жіберілген Қазақстан Республикасының резидент заңды тұлғаларының акциялары және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p> | 80 | | |
| | <p>қор биржасының ресми тізімінің "Балама" алаңының "акциялар"</p> | | | |

| | | | | | |
|-----|--|-----|--|--|--|
| 3.4 | <p>секторына енгізілген Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының акциялары немесе "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының "аймақтық акциялар нарығының сегменті" ресми тізімінің кіші бөліміне енгізілген Қазақстан Республикасын ың заңды тұлғаларының акциялары, жария активтерге жіберілген және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p> | 60 | | | |
| 3.5 | <p>Қазақстан Республикасын ың заңды тұлғаларының және Standard & Poog's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" -тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар</p> | 100 | | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|----|--|--|
| | шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | | | |
| 3.6 | Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-қа дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | 80 | | |
| 3.7 | Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік | | 60 | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|----|--|--|
| | агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | | | |
| 4 | Өзге бағалы қағаздар - барлығы, оның ішінде: | | | | |
| 4.1 | қор биржасының ресми тізіміне енгізілген инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары | | 70 | | |
| 4.2 | активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайлары немесе негізгі қор индексіне байланысты пайлар бойынша баға белгілеу | | 90 | | |
| 4.3 | Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс), | | 80 | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| | Exchange Traded Commodities (ETC) (Экстейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Экстейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары | | | | |
| 4.4 | орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар | | 100 | | |
| 5 | Өзге бағалы қағаздар - барлығы, оның ішінде: | | | | |
| 5.1 | Тазартылған бағалы металдар және металл шоттар | | 100 | | |
| 5.2 | Бағалы қағаздар нарығындағы кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (инвестициялық портфельді басқарушының үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - инвестициялық портфельді | | 100 | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| | басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада | | | | |
| 5.3 | Бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің аяқталуына байланысты туындайтын бағалы қағаздардың номиналды құнын төлеу бойынша қойылатын талаптар (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің шарттары бойынша мерзімі өтпеген) | | 100 | | |
| 5.4 | Инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі инвестициялық портфельді басқарушының негізгі құрал-жабдықтары | | 100 | | |
| 6 | Өтімді активтердің жиынтығы | | | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|----|---|--|--|--|--|
| 7 | Баланс бойынша міндеттемелер | | | | |
| 8 | Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері | | | | |
| 9 | Меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті | | | | |
| 10 | Өтімділік коэффициенті | | | | |

Өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін
Қазақстан Республикасының пруденциялық реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне
4-қосымша
Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 79 қаулысына
2-қосымша

Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі (бұдан әрі - Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы (бұдан әрі-Заң) 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" 2003 жылғы 4 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес әзірленді және инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың (бұдан әрі-инвестициялық портфельді басқарушылар) сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

2-тарау. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға жататын пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

2. Инвестициялық портфельді басқарушылар меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициентін мына формула бойынша есептейді:

$$K = (\Theta A - M) / MKTM, \text{ мұндағы:}$$

ӨА - Әдістеменің 8-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын, инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күнгі жағдай бойынша қолдағы бар өтімді активтері ;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

МКТМ - Әдістеменің 6-тармағына сәйкес есептелген, меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын, инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының ең төменгі мөлшері.

3. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын инвестициялық портфельді басқарушы үшін МКТМ Әдістемесінің 7-тармағына сәйкес, басқаруға қабылданған өзге активтердің мөлшеріне қарамастан есептеледі.

4. Меншікті капиталдың ең төмен мөлшерін есептеу мақсаты үшін республикалық бюджет туралы заңмен тиісті қаржы жылына белгіленген айлық есептік көрсеткіш (бұдан әрі - АЕК) мөлшері пайдаланылады.

5. Инвестициялық портфельді басқарушының өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$$\Theta_k = \Theta_A / M,$$
 мұндағы:

ӨА - инвестициялық портфельді басқарушының Әдістемесінің 8-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын, есептеу күніндегі өтімді активтері;

М - есептеу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

6. Егер:

басқаруға қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден аз болса, онда МКТМ 75 000 (жетпіс бес мың) АЕК-ке тең болады;

басқаруға қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден астам болса, онда МКТМ 75 000 (жетпіс бес мың) АЕК-ке тең + (БҚА - 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге) * 0,0014 болады, мұндағы БҚА басқаруға қабылданған активтер болып табылады.

7. Егер:

сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны 100 000 000 000 (бір жүз миллиард) теңгеден кем болса, МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ке тең;

сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны 100 000 000 000 (бір жүз миллиард) теңгеден астам соманы құраса, МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК + (СБҚЗА) - 100 000 000 000 (жүз миллиард) теңге) * 0,05, мұнда СБҚЗА сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтері болып табылады.

8. Инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтері ретінде осы қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін

есептеу Қағидаларына (бұдан әрі - Қағидалар) қосымшаға сәйкес инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген активтер танылады.

9. Әдістеменің 8-тармағында көзделген өтімді активтер есебіне мыналар енгізілмейді:

1) инвестициялық портфельді басқарушының міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) инвестициялық портфельді басқарушының меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндері есебінің кестесінде көрсетілген көлемде инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтер (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) есебіне енгізіледі;

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері реп" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздар инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) параметрлері қор биржасының акциялар нарығының индексін есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне (қор биржасының өкілдік тізімі) кіретін акцияларды қоспағанда, инвестициялық портфельді басқарушыға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар.

Өзгерістер мен толықтырулар
енгізілетін

Қазақстан Республикасының
пруденциялық реттеу мәселелері
бойынша нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
5-қосымша

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

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 есептеу мақсаты үшін тиісті қаржы жылына арналған республикалық бюджет туралы заңмен белгіленген айлық есептік көрсеткіш (бұдан әрі – АЕК) мөлшері қолданылады.

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:

Азиялық даму банкі (Asian Development Bank);

Америкааралық даму банкі (Inter-American Development Bank);

Африкалық даму банкі (African Development Bank);

Еуразия даму банкі (Eurasian Development Bank);

Еуропа қайта құру және даму банкі (European Bank for Reconstruction and Development);

Еуропа инвестициялық банкі (European Investment Bank);

Еуропа Кеңесінің Даму Банкі (the Council of Europe Development Bank);

Жеке секторды дамыту жөніндегі исламдық корпорация (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);

Ислам даму банкі (Islamic Development Bank);

Жан-жақты инвестицияларға кепілдік беру агенттігі (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 (International Bank for Reconstruction and Development);

Халықаралық қаржы корпорациясы (International Finance Corporation).

8. Уәкілетті орган Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің рейтингтік бағаларынан басқа 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 бекітілген Moody's

Investors Service және Fitch (Мудис Инвесторс Сервис және Фич) агенттіктерінің (бұдан әрі - басқа рейтингтік агенттіктер) рейтингтік бағаларын да таниды.

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 ұйымдардың сақтауға
міндетті пруденциялық
нормативтердің мәндерін
есептеу қағидаларына
қосымша

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

| № | Көрсеткіштің атауы | Баланс бойынша сомасы | Ескерілетін көлем (пайызбен) | Есептеу сомасы | Ескерту |
|---|---|-----------------------|------------------------------|----------------|---------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | |
| 1 | Барлық ақша және салымдар, оның ішінде: | | | | |
| | Ұйымның балансы бойынша | | | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| 1.1 | активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада кассадағы ақша | | 100 | | |
| 1.2 | о с ы қосымшаның 1.9 және 1.10-жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша | | 100 | | |
| 1.3 | о с ы қосымшаның 1.11-жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша | | 90 | | |
| 1.4 | орталық депозитарий шоттарындағы ақша | | 100 | | |
| 1.5 | клирингтік ұйымның (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарна, маржа салымдары, а ш ы қ сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен қор биржасының сауда-саттық жүйесінде | | 100 | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| | <p>жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын Ұйымның ақшасы</p> | | | | |
| 1.6 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша</p> | | 100 | | |
| 1.7 | <p>"Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасы Заңының 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық</p> | | 100 | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| | шкаласы бойынша "BBB" төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент ұйымдарындағы шоттардағы ақша | | | | |
| 1.8 | Бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша Халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) | | 100 | | |
| 1.9 | Осы банктер қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізімінде болатын эмитенттер болған жағдайда | | 100 | | |

| | | | | | |
|------|--|-----|--|--|--|
| | , Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар | | | | |
| 1.10 | <p>Мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар:</p> <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B" төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB +" төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар;</p> <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы</p> | 100 | | | |

| | | | | | |
|------|---|----|--|--|--|
| | <p>бойынша "А-" төмен емес ш е т е л валютасында ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасын ың бейрезидент бас банктері Қазақстан Республикасын ың резидент еншілес банктері болып табылады</p> | | | | |
| 1.11 | <p>Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В-" ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі, немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-ден "kzBB"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан</p> | 90 | | | |

| | | | | | |
|------|--|--|-----|--|--|
| | Республикасын ың екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар | | | | |
| 1.12 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "AA-" төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдарындағы салымдар, Еуразиялық Даму Банкіндегі Қазақстан Республикасын ың ұлттық валютасындағы салымдар | | 100 | | |
| 1.13 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар бейрезидент банктердегі салымдар | | 100 | | |
| | | | | | 2021 жылғы 1 қазаннан бастап борыштық бағалы қағаздардың құрамында орталық |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| 2 | Борыштық бағалы қағаздар - барлығы, оның ішінде: | | | | контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын борыштық бағалы қағаздар есепке алынбайды |
| 2.1 | Б а с қ а мемлекеттердің заңнамасына сәйкес айналысқа шығарылғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары | | 100 | | |
| 2.2 | Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған, Қазақстан Республикасының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген борыштық бағалы қағаздар | | 100 | | |
| | акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік | | | | |

| | | | | | |
|-----|---|-----|--|--|--|
| 2.3 | <p>қызметке байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар</p> | 100 | | | |
| 2.4 | <p>Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес "Қазақстанның Даму Банкі", "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі, "Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар</p> | 100 | | | |
| | <p>Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына кіретін Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік</p> | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|----|--|--|--|
| 2.5 | <p>емес бағалы қағаздары немесе шетел валютасында номинирленген және қор биржасының "Негізгі" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында ашық сауда-саттыққа жіберілген Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | 90 | | | |
| | <p>Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Балама" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік</p> | | | | |

| | | | | |
|-----|--|----|--|--|
| 2.6 | <p>емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының " Балама" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін " Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында ашық сауда-саттыққа жіберілген Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | 60 | | |
| | <p>Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, (эмитентте) Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-" төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі</p> | | | |

| | | | | | |
|-----|---|-----|--|--|--|
| 2.7 | рейтингі бар немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzA-" төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары | 100 | | | |
| 2.8 | Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, (эмитентте) Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-дан "B-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің | 85 | | | |

| | | | | |
|-----|---|-----|--|--|
| | <p>ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | | | |
| 2.9 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "AA-" төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразиялық Даму Банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген борыштық бағалы қағаздар</p> | 100 | | |
| | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс)</p> | | | |

| | | | | | |
|------|---|-----|--|--|--|
| 2.10 | <p>агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-" төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары</p> | 100 | | | |
| 2.11 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+"-дан "BB-"-қа дейінгі тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары</p> | 90 | | | |
| 2.12 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "B+"-дан "B-"-қа дейінгі тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар ш е т мемлекеттердің</p> | 80 | | | |

| | | | | | |
|------|--|--|-----|--|--|
| | <p>борыштық бағалы қағаздары</p> | | | | |
| 2.13 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-" төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар (эмитентте) шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | | 100 | | |
| 2.14 | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+"-дан "BB-"-қа дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің (эмитентте) мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары</p> | | 85 | | |
| | <p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "B+"-дан "B-"-қа</p> | | | | |

| | | | | | |
|------|---|--|-----|--|---|
| 2.15 | дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар шетелдік эмитенттердің (эмитентте) мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары | | 70 | | |
| 3 | Акциялар және депозитарлық қолхаттар - барлығы, оның ішінде: | | | | 2021 жылғы 1 қазаннан бастап акциялар мен депозитарлық қолхаттардың құрамында орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттар есепке алынбайды |
| 3.1 | негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | 100 | | |
| | қор биржасының ресми тізіміне " | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| 3.2 | Негізгі" алаңының " акциялар" секторы " премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін, қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлғалардың акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | 100 | | |
| 3.3 | қор биржасының ресми тізімінің " Негізгі" алаңы " акциялар" секторының " стандарт" санатына енгізілген Қазақстан Республикасының резидент заңды тұлғаларының акциялары немесе осы Қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген акциялар және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттарды санамағанда, " Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, | | 80 | | |

| | | | | | |
|-----|--|----|--|--|--|
| | <p>ж а р и я сауда-сатыққа жіберілген Қазақстан Республикасын ың резидент з а ң д ы тұлғаларының акциялары және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар</p> | | | | |
| 3.4 | <p>қор биржасының ресми тізімінің " " Балама " " алаңының " акциялар" секторына енгізілген Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының акциялары немесе "Астана" халықаралық қ а р ж ы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының "Аймақтық акциялар нарығының сегменті" ресми тізімінің кіші бөліміне енгізілген Қазақстан Республикасын ың заңды тұлғаларының акциялары ж а р и я сауда-сатыққа жіберілген және базалық активі осы акциялар б о л ы п</p> | 60 | | | |

| | | | | | |
|-----|---|--|-----|--|--|
| | табылатын депозитарлық қолхаттар | | | | |
| 3.5 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-" төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай 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 (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+"-дан "BB-"-ка дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар | | 80 | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|----|--|--|
| | болып табылатын депозитарлық қолхаттар | | | | |
| 3.7 | Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "B+"-дан "B-"-қа дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осындай 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 | қор биржасының ресми тізіміне енгізілген инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары | | 70 | | |
| | активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе олардың пайлар бойынша баға | | | | |

| | | | | | |
|-----|---|-----|--|--|--|
| 4.2 | <p>белгілеулері негізгі қор индексіне байланысты болатын Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайлары</p> | 90 | | | |
| 4.3 | <p>Morningstar рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (ETC) (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары</p> | 80 | | | |
| 4.4 | <p>орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар</p> | 100 | | | |
| 5 | <p>Өзге активтер - барлығы, оның ішінде:</p> | | | | |
| 5.1 | <p>Тазартылған бағалы металдар және металл шоттар</p> | 100 | | | |
| | <p>Бағалы қағаздар нарығындағы кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде</p> | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|-----|--|--|--|
| 5.2 | <p>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</p> | 100 | | | |
| 5.3 | <p>Бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде қарастырылған бағалы қағаздардың айналыс мерзімінің аяқталуына байланысты туындайтын бағалы қағаздардың номиналды құнын төлеуге қойылатын талаптар (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің шарттары бойынша мерзімі өтпеген)</p> | 100 | | | |
| | <p>Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан</p> | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|--|-----|--|--|
| 5.4 | аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі Ұйымның негізгі құрал-жабдықтары | | 100 | | |
| 6 | Өтімді активтердің жиынтығы | | | | |
| 7 | Баланс бойынша міндеттемелер | | | | |
| 8 | Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері | | | | |
| 9 | Меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті | | | | |
| 10 | Өтімділік коэффициенті | | | | |

Өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін Қазақстан Республикасының пруденциялық реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне
6-қосымша
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

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидалары (бұдан әрі – Қағидалар) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңының (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасының Заңының 12-бабының 9-3) тармағына 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. Брокердің және (немесе) дилердің пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі

2. Брокер және (немесе) дилер меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициентін мынадай формула бойынша есептейді:

$K = (LA - O) / MKAM$, мұндағы:

LA-есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 4-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері;

O-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

MKAM-брокердің және (немесе) дилердің меншікті капиталының жеткіліктілігі есебіне алынатын ең аз мөлшері:

Номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы бар брокердің және (немесе) дилердің МКАМ 75 000 (жетпіс бес мың) АЕК-ті құрайды;

Клиенттердің шоттарын жүргізу құқығы жоқ брокердің және (немесе) дилердің МКАМ, 53 000 (елу үш мың) АЕК-ті құрайды.

3. Брокердің және (немесе) дилердің өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$Kл = LA / O$, мұндағы:

LA-есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 4-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері;

O-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

4. Брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері ретінде тиісті көлемдерде бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу Қағидаларына на (бұдан әрі - қағидалар) қосымшаға сәйкес "бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінде" көрсетілген активтер танылады.

5. Әдістеменің 4-тармағында көзделген өтімді активтердің есебіне 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 бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерінің есебінде көрсетілген көлемде осы Қағидаларға қосымшаға сәйкес нысан бойынша брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

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

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

3-тарау. ЕЖЗҚ-ның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі

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

$$K = (LA - O) / MKAM, \text{ мұндағы:}$$

LA-Әдістеменің 9-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

O-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

MKAM-Әдістеменің 8-тармағына сәйкес есептелген, меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын ЕЖЗҚ меншікті капиталының ең аз мөлшері.

7. ЕЖЗҚ өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$$Kл = LA/O, \text{ мұндағы:}$$

LA-Әдістеменің 9-тармағында көрсетілген есептеу күніне қолда бар ЕЖЗҚ өтімді активтері;

O-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

8. Егер:

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

инвестициялық басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден асады, онда МКAM 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.

9. Ереженің 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.

10. Әдістеменің 9-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 нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар ЕЖЗҚ-ның өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

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

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

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

11. ЕЖЗҚ-ның меншікті активтері есебінен мәмілелер Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 8815 болып тіркелген, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2013 жылғы 27 тамыздағы № 237 қаулысымен бекітілген Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорының және (немесе) ерікті жинақтаушы зейнетақы қорларының қызметін жүзеге асыру қағидаларының 2-тарауында белгіленген тәртіппен жасалады.

3-тарау. УПИ1 немесе УПИ2 пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу әдістемесі

12. УПИ1 немесе УПИ2 меншікті капиталының жеткіліктілік коэффициенті мынадай формула бойынша есептеледі:

$$K = (JA - O) / MKAM,$$
 мұндағы:

JA-есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 15-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын УПИ1 немесе УПИ2 өтімді активтері;

O-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер;

MKAM-Қағидалардың 14-тармағына сәйкес есептелген, меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын, УПИ1 немесе УПИ2 меншікті капиталының ең аз мөлшері. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы

активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын УПИ1 немесе УПИ2 үшін МКАМ басқаруға қабылданған өзге активтердің мөлшеріне қарамастан Әдістеменің 14-тармағының 3) және 4) тармақшаларына сәйкес есептеледі.

13. УПИ1 немесе УПИ2 өтімділік коэффициенті мына формула бойынша есептеледі :

$Kл = ЛА/О$, мұндағы:

ЛА-есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 15-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын УПИ1 немесе УПИ2 өтімді активтері;

О-есеп айырысу күніндегі баланс бойынша міндеттемелер.

14. Егер:

1) УПИ басқаруына қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден кем болса, МКАМ 107 000 (жүз жеті мың) АЕК-ке тең;

УПИ 1 басқаруына қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден астам соманы құрайды, онда МКАМ 107 000 (жүз жеті мың) АЕК + (АПУ - 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)*0,0001, мұнда АПУ инвестициялық басқаруға қабылданған активтер болып табылады;

2) УПИ2 басқаруына қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден кем болса, МКАМ 85 000 (сексен бес мың) АЕК-ке тең;

УПИ2 басқаруына қабылданған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден астам соманы құрайды, онда МКАМ 85 000 (сексен бес мың) АЕК + (АПУ - 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)*0,0001, мұнда АПУ инвестициялық басқаруға қабылданған активтер болып табылады;

3) УПИ1 немесе УПИ2 сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны 100 000 000 000 (бір жүз миллиард) теңгеден кем болса, онда МКАМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ке тең;

4) УПИ1 немесе УПИ2 сенімгерлік басқаруға қабылдаған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны 100 000 000 000 (бір жүз миллиард) теңгеден астам соманы құраса, онда МКАМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК + (ПАПУ - 100 000 000 000 (бір жүз миллиард) теңге) * 0,05, мұнда ПАПУ УПИ1 немесе УПИ2 сенімгерлік басқаруға қабылдаған зейнетақы активтері болып табылады.

15. Қағидалардың қосымшасына сәйкес тиісті көлемдерде Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген активтер УПИ1 немесе УПИ2 өтімді активтері ретінде танылады.

16. Әдістеменің 15-тармағында көзделген УПИ1 немесе УПИ2 өтімді активтерінің есебіне енгізілмейді:

1) УПИ1 немесе УПИ2 міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) УПИ1 немесе УПИ2 меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидалардың қосымшасына 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 УПИ1 немесе УПИ2 өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

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

2) параметрлері қор биржасының акциялар нарығының индексін есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, УПИ1 немесе УПИ2-ге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар (қор биржасының өкілдік тізімі).