

Об утверждении Инструкции о мерах по поддержанию крупным участником управляющего инвестиционным портфелем коэффициента достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем

Утративший силу

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 26 июля 2013 года № 200. Зарегистрирован в Министерстве юстиции Республики Казахстан 11 сентября 2013 года № 8697. Утратил силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 ноября 2017 года № 208.

Сноска. Утратил силу постановлением Правления Национального Банка РК от 02.11.2017 № 208 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 21 июня 2013 года "О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан" Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. Утвердить прилагаемую Инструкцию о мерах по поддержанию крупным участником управляющего инвестиционным портфелем коэффициента достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем (далее - Инструкция).

2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования.

3. Управляющим инвестиционным портфелем в течение двух месяцев со дня введения в действие настоящего постановления привести свою деятельность в соответствие с требованиями Инструкции.

Председатель

Национального Банка

Г. Марченко

Утверждена
постановлением Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 26 июля 2013 года № 200

Инструкция

о мерах по поддержанию крупным участником управляющего инвестиционным портфелем коэффициента достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем

1. Настоящая Инструкция о мерах по поддержанию крупным участником управляющего инвестиционным портфелем, коэффициентов достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем, (далее - Инструкция) разработана в соответствии с законами Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", от 21 июня 2013 года "О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан" и устанавливает меры по поддержанию крупным участником коэффициентов достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем (далее – Управляющий).

2. Крупный участник Управляющего (далее - крупный участник) принимает меры по поддержанию на достаточном уровне коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего, предусмотренные настоящей Инструкцией.

3. Меры по поддержанию крупным участником коэффициентов достаточности собственного капитала Управляющего, включают в себя:

1) разработку и утверждение внутренних документов крупным участником, являющимся юридическим лицом, устанавливающих обязательные для соблюдения крупным участником условия и порядок применения мер по поддержанию коэффициентов достаточности собственного капитала Управляющего;

2) постоянное обеспечение необходимого уровня (значения) коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего;

3) оперативное обеспечение необходимого уровня (значения) коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего.

4. Меры, принимаемые крупным участником по постоянному обеспечению необходимого значения коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего, включают следующее:

1) ежеквартальную оценку финансового состояния Управляющего на основе анализа ежеквартальной финансовой отчетности Управляющего, с целью проверки соблюдения пруденциальных нормативов, установленных в отношении Управляющего, а также оценку рисков, влияющих на снижение коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего;

2) ежеквартальную оценку прогнозных значений достаточности собственного капитала Управляющего;

3) ежегодный контроль за обеспечением эффективности функционирования системы управления рисками Управляющего, в том числе, оценок соответствия указанных систем требованиям, установленным статьей 52 Закона Республики Казахстан от 21 июня 2013 года "О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан";

4) ежегодный контроль наличия в Управляющем, имеющем крупного участника, процедур, определяющих необходимость применения мер оперативного обеспечения, предусмотренных в пункте 6 Инструкции;

5) ежеквартальный контроль соблюдения Управляющим, имеющим крупных участников, инвестиционной декларации единого накопительного пенсионного фонда и (или) добровольного накопительного пенсионного фонда при инвестировании пенсионных активов и политики инвестирования собственных активов Управляющего при инвестировании собственных активов;

6) принятие мер предусмотренных планом рекапитализации Управляющего, в случае возможного ухудшения финансового положения Управляющего, составленным в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 67 "Об утверждении Правил выдачи, отзыва согласия на приобретение статуса крупного участника банка, банковского холдинга, крупного участника страховой (перестраховочной) организации, страхового холдинга, крупного участника управляющего инвестиционным портфелем и требования к документам, представляемым для получения указанного согласия", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7552.

Сноска. Пункт 4 с изменениями, внесенными постановлением Правления Национального Банка РК от 28.10.2016 № 265 (вводится в действие по истечении двадцати одного календарного дня после дня его первого официального опубликования).

5. При снижении коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего, крупным участником дополнительно, помимо мер постоянного обеспечения коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего, применяются меры оперативного обеспечения.

6. Меры оперативного обеспечения предусматривают:

1) действия по обеспечению необходимого значения коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего;

2) действия по изменению структуры собственных активов Управляющего;

3) действия по изменению организационной структуры Управляющего;

4) действия по приостановлению начисления и (или) выплаты дивидендов по простым акциям (распределения чистого дохода) Управляющего между его акционерами.

7. Действия по обеспечению необходимого значения коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего включают, но не ограничиваются, приобретением крупным участником размещаемых акций

Управляющего и оплатой стоимости данных акций в целях приведения необходимого размера коэффициента достаточности собственного капитала Управляющего к нормативному значению.

8. Действия по изменению структуры собственных активов Управляющего осуществляются в виде:

1) ограничения или приостановления операций, подвергающих Управляющего кредитному и (или) рыночному рискам;

2) реструктуризации инвестиционного портфеля Управляющего с целью снижения рисков по портфелю;

3) сокращения перечня и объема проводимых операций, связанных со значительными расходами или подвергающих Управляющего дополнительным рискам.

9. Действия, по изменению организационной структуры Управляющего осуществляются в виде:

1) сокращения административно-хозяйственных расходов, в том числе посредством ограничения дополнительного найма работников;

2) изменения штатной численности Управляющего;

3) изменения состава инвестиционного комитета.