

Об установлении пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем, утверждении Правил расчета значений пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем и внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам рынка ценных бумаг

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 3 февраля 2014 года № 7. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 13 мая 2014 года № 9410. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 апреля 2018 года № 79, за исключением подпункта 2) пункта 2 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 27.04.2018 № 79, за исключением подпункта 2) пункта 2 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Сноска. Заголовок в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 27.03.2017 № 54 (вводится в действие с 01.06.2017).

В соответствии с законами Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг" от 4 июля 2003 года, "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций" Правление Национального Банка Республики Казахстан ПОСТАНОВЛЯЕТ:

1. Установить для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем, пруденциальный норматив "Коэффициент достаточности собственного капитала".

Значение коэффициента достаточности собственного капитала ежедневно должно составлять не менее 1.

2. Утвердить:

1) прилагаемые Правила расчета значений пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем согласно приложению 1 к настоящему постановлению;

2) прилагаемый Перечень нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам деятельности на рынке ценных бумаг, в которые вносятся изменения и дополнения согласно приложению 2 к настоящему постановлению.

Сноска. Пункт 2 с изменениями, внесенными постановлением Правления Национального Банка РК от 27.03.2017 № 54 (вводится в действие с 01.06.2017).

3. Признать утратившими силу нормативные правовые акты Республики Казахстан согласно приложению 3 к настоящему постановлению.

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

Председатель

Национального Банка

К. Келимбетов

СОГЛАСОВАНО

Председатель

Приложение 1
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 3 февраля 2014 года № 7

Правила расчета значений пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем

Сноска. Заголовок в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 27.03.2017 № 54 (вводится в действие с 01.06.2017).

Настоящие Правила расчета пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем (далее - Правила), разработаны в соответствии с законами Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций" и устанавливают порядок расчета пруденциального норматива "Коэффициент достаточности собственного капитала", обязательного к соблюдению организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем (далее - управляющий инвестиционным портфелем).

Правила не распространяются на организации, осуществляющие управление инвестиционным портфелем с правом привлечения добровольных пенсионных взносов.

Золотовалютные активы Национального Банка Республики Казахстан и активы Национального фонда Республики Казахстан, переданные в доверительное управление, не учитываются при расчете пруденциального норматива организации, осуществляющей управление инвестиционным портфелем.

Нормы, предусмотренные Правилами, в части аффилированных лиц управляющего инвестиционным портфелем не применяются к юридическим лицам и их аффилированным лицам, являющимся аффилированными с управляющим инвестиционным портфелем в результате прямого (по банкам - косвенного) владения двадцатью пятью и более процентами голосующих акций указанных организаций акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына".

1. Порядок расчета пруденциального норматива - "Коэффициент достаточности собственного капитала"

1. Коэффициент достаточности собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем рассчитывается по формуле:

$$K = (Л\text{А} - О) / \text{МРСК}, \text{ где}$$

Л\text{А} - ликвидные активы управляющего инвестиционным портфелем, которые признаются ликвидными в соответствии с пунктом 5 Правил;

О – обязательство по балансу;

МРСК - минимальный размер собственного капитала управляющего инвестиционным портфелем, принимаемый в расчет достаточности собственного капитала, рассчитанный в соответствии с пунктом 2 Правил.

2. Если:

стоимость активов, принятых в управление, составляет менее 40 000 000 000 (сорока миллиардов) тенге, то $\text{МРСК} = 181\,440\,000$ (ста восьмидесяти одному миллиону четырестам сорока тысячам) тенге;

стоимость активов, принятых в управление, составляет более 40 000 000 000 (сорока миллиардов) тенге, то $\text{МРСК} = 181\,440\,000$ (ста восьмидесяти одному миллиону четырестам сорока тысячам) тенге + $(\text{АПУ} - 40\,000\,000\,000 \text{ (сорок миллиардов) тенге}) \cdot 0,0014$,

где АПУ - активы, принятые в управление.

Максимальное значение МРСК не должно превышать 1 600 000 000 (одного миллиарда шестисот миллионов) тенге.

3. Помимо рейтинговых оценок агентства Standard & Poor's Национальным Банком Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган) также признаются рейтинговые оценки агентств Moody's Investors Service и Fitch, и их дочерних рейтинговых организаций (далее - другие рейтинговые агентства).

4. Для целей Правил под международными финансовыми организациями понимаются следующие организации:

Азиатский банк развития (the Asian Development Bank);

Африканский банк развития (the African Development Bank);

Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank);

Евразийский банк развития (Eurasian Development Bank);

Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development);

Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank);

Исламская корпорация по развитию частного сектора (ICD);

Исламский банк развития (the Islamic Development Bank);

Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank);

Международная ассоциация развития;

Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation);

Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development);

;

Международный валютный фонд;

Международный центр по урегулированию инвестиционных споров;

Многостороннее агентство гарантии инвестиций;

Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank).

5. В качестве ликвидных активов управляющего инвестиционным портфелем в объемах, предусмотренных приложением к Правилам, признаются следующие собственные активы:

1) деньги, в том числе:

деньги в кассе, не более десяти процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем;

деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в подпункте 2) настоящего пункта;

собственные деньги на счетах в центральном депозитории;

собственные деньги на счетах в клиринговой организации, являющиеся гарантийными, маржевыми взносами управляющего инвестиционным портфелем;

деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах Республики Казахстан, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже категории "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;

деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, предоставляющих банковские услуги организациям для осуществления операций на организованном рынке ценных бумаг;

2) вклады в банках второго уровня Республики Казахстан с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери в объемах, указанных в приложении к Правилам, при соответствии одному из следующих условий:

банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzB" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;

банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "A-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;

банки являются банками - эмитентами, включенными в сектор "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи или банками-эмитентами, акции которых находятся в представительском списке индекса фондовой биржи;

- 3) вклады в банках-нерезидентах с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;
- 4) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;
- 5) долговые ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;
- 6) акции юридических лиц Республики Казахстан, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери;
- 7) акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц, находящиеся в представительском списке индекса фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери;
- 8) негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтинговую оценку не ниже "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;
- 9) негосударственные долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку ниже уровня, указанного в подпункте 8) настоящего пункта, а также не имеющие рейтинговую оценку, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;
- 10) негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в официальный список фондовой биржи, за исключением ценных бумаг, указанных в подпунктах 8), 9) настоящего пункта, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери, соответствующие следующим требованиям:
- государственная регистрация эмитента долговых ценных бумаг осуществлена не менее чем за два года до дня подачи заявления о включении его ценных бумаг в официальный список фондовой биржи;
- эмитент долговых ценных бумаг составляет финансовую отчетность в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности (International Financial Reporting Standards - IFRS) или стандартами финансовой отчетности, действующими в Соединенных Штатах Америки (General Accepted Accounting Principles - GAAP);
- аудит финансовой отчетности эмитента долговых ценных бумаг производится одной из аудиторских организаций, входящих в перечень признаваемых фондовой биржей аудиторских организаций;
- финансовая отчетность эмитента долговых ценных бумаг, подтвержденная аудиторским отчетом, представлялась не менее, чем за два завершенных финансовых года;
- собственный капитал эмитента долговых ценных бумаг составляет сумму, эквивалентную не менее двум миллионам пятидесяти тысячекратному размеру месячного расчетного показателя, установленному законом о республиканском бюджете на соответствующий финансовый год, согласно финансовой отчетности на последнюю отчетную дату, подтвержденной аудиторским отчетом;
- чистая прибыль эмитента долговых ценных бумаг за один год из двух последних лет составляет сумму, эквивалентную не менее восьмидесяти пяти тысяч шестисоткратному размеру месячного расчетного показателя, установленному законом о республиканском бюджете на соответствующий финансовый год, согласно финансовой отчетности на последнюю отчетную дату, подтвержденной аудиторским отчетом;

объем продаж эмитента долговых ценных бумаг - нефинансовой организации, за исключением лизинговой организации и кредитного товарищества, по основной деятельности за каждый из двух последних лет по данным финансовой отчетности, подтвержденной аудиторским отчетом, составляет сумму, эквивалентную не менее двум миллионам пятидесяти тысячкратному размеру месячного расчетного показателя, установленному законом о республиканском бюджете на соответствующий финансовый год;

наличие кодекса корпоративного управления, утвержденного общим собранием акционеров эмитента долговых ценных бумаг;

наличие маркет-мейкера по долговым ценным бумагам во время нахождения данных ценных бумаг в официальном списке фондовой биржи;

в учредительных документах эмитента долговых ценных бумаг и (или) проспекте выпуска эмиссионных ценных бумаг не содержится норм, которые ущемляют или ограничивают права собственников ценных бумаг на их отчуждение (передачу);

11) ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

12) негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

13) акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

14) депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери;

15) депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции эмитентов Республики Казахстан, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери;

16) депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции юридических лиц, включенные в сектор "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц, находящиеся в представительском списке индекса фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери;

17) долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющие международную рейтинговую оценку не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

18) аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты;

19) акции организаторов торгов с ценными бумагами и иных юридических лиц, являющихся частью инфраструктуры рынка ценных бумаг, акционерами которых являются профессиональные участники рынка ценных бумаг за вычетом резервов на возможные потери;

20) дебиторская задолженность (за вычетом резервов на возможные потери) организаций, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, за вычетом дебиторской задолженности работников и других лиц, не просроченная по условиям договора, в сумме, не превышающей десяти процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем ;

21) основные средства управляющего инвестиционным портфелем в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей пяти процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем.

Сноска. Пункт 5 с изменениями, внесенными постановлениями Правления Национального Банка РК от 16.07.2014 № 152 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования); от 24.12.2014 № 244 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования); от 27.03.2017 № 54 (вводится в действие с 01.06.2017).

6. В случае совмещения управляющего инвестиционным портфелем профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг расчет пруденциального норматива - "Коэффициент достаточности собственного капитала" и другие нормативы осуществляются с учетом особенностей, установленных постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 16 июля 2014 года № 146 "Об установлении пруденциального норматива для организаций, осуществляющих брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, утверждении Правил расчета пруденциального норматива для организаций, осуществляющих брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 9736.

Сноска. Пункт 6 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 19.12.2015 № 250 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

7. Управляющий инвестиционным портфелем производит расчет пруденциального норматива каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня с соблюдением требования, указанного в пункте 12 Правил, по форме согласно приложению к Правилам. Расчет пруденциального норматива и дополнительные сведения для расчета пруденциального норматива (далее – дополнительные сведения) на бумажных носителях подписываются первым руководителем (на период его отсутствия – лицом, его замещающим), главным бухгалтером управляющего инвестиционным портфелем, заверяются печатью и хранятся у управляющего инвестиционным портфелем.

2. Порядок представления расчета пруденциального норматива и дополнительных сведений для расчета пруденциального норматива

8. Расчет пруденциального норматива и дополнительные сведения представляются в уполномоченный орган в соответствии с приложением к Правилам за последний календарный день отчетного месяца, не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

9. Расчет пруденциального норматива и дополнительные сведения представляются в электронном формате .

Сноска. Пункт 9 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 29.01.2018 № 5 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования) .

10. Исключен постановлением Правления Национального Банка РК от 29.01.2018 № 5 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

11. Данные в расчете пруденциального норматива и дополнительных сведениях указываются в национальной валюте Республики Казахстан - тенге.

12. Единица измерения, используемая при заполнении расчета пруденциального норматива и дополнительных сведений, устанавливается в тысячах тенге. Сумма менее пятисот тенге округляется до нуля, а сумма, равная пятистам тенге и выше, округляется до тысячи тенге.

13. Дополнительные сведения и расчет пруденциального норматива в электронном формате представляются с использованием транспортной системы гарантированной доставки информации с криптографическими средствами защиты, обеспечивающей конфиденциальность и некорректируемость представляемых данных.

14. Идентичность данных, представляемых в электронном формате, данным на бумажном носителе обеспечивается первым руководителем управляющего инвестиционным портфелем (на период его отсутствия – лицом, его замещающим) и главным бухгалтером.

15. В случае необходимости внесения изменений и (или) дополнений в отчетность, управляющий инвестиционным портфелем представляет в уполномоченный орган доработанную отчетность и письменное объяснение с указанием причин необходимости внесения изменений и (или) дополнений в отчетность.

16. В случае нарушения пруденциального норматива "Коэффициент достаточности собственного капитала" управляющий инвестиционным портфелем в течение трех календарных дней с даты нарушения сообщает уполномоченному органу о факте и причинах нарушения пруденциального норматива с приложением плана мероприятий по его устранению.

**Приложение
к Правилам расчета значений
пруденциального норматива
для организаций, осуществляющих
управление
инвестиционным портфелем**

Сноска. Приложение в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 27.03.2017 № 54 (вводится в действие с 01.06.2017).

**Форма, предназначенная для сбора административных данных
Расчет пруденциального норматива**
Отчетный период: по состоянию на "_____" _____ 20__ года
И н д е к с : К 1 - У И П
Периодичность: ежемесячная

Представляют: организации, осуществляющие управление инвестиционным
п о р т ф е л е м

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее 5 (пятого) рабочего дня месяца, следующего за
отчетным месяцем

Форма

(наименование организации, осуществляющей управление инвестиционным портфелем)

**Таблица 1. Расчет норматива достаточности собственного капитала
(в тысячах тенге)**

№	Наименование показателя	Сумма п о балансу	Учитываемый объем (%)	Сумма к расчету
1.	Деньги - всего (сумма строк 1.11.5.), в том числе;		100	
1.1	деньги в кассе (не более 10 (десяти) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем)		100	
1.2	деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанные в подпункте 2) пункта 5 Правил		100	
1.3	собственные деньги на счетах в центральном депозитарии		100	
1.4	собственные деньги на счетах в клиринговой организации, являющиеся гарантийными, маржевыми взносами управляющего инвестиционным портфелем		100	
1.5	деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах Республики Казахстан, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже категории "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств		100	
1.6	деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, предоставляющих банковские услуги организациям для осуществления операций на организованном рынке ценных бумаг		100	
	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери, при соответствии одному из			

2.	следующих условий: банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzB" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств; банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "A-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств		100	
3.	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери, при условии, что данные банки - эмитенты включены в сектор "акции" официального списка фондовой биржи.		100	
4.	Вклады в банках-нерезидентах с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже категории "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств		100	
5.	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
6.	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
7.	Акции юридических лиц Республики Казахстан, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери		100	
8.	Акции юридических лиц, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям секторов "акции" соответствующих площадок официального списка фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери		100	
9.	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющие рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по			

	национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
10.	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющие рейтинговую оценку от "B+" до "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzB+" до "kzB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
11.	Негосударственные долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку ниже уровня, указанного строках 9 и 10 настоящего приложения, а также не имеющие рейтинговую оценку, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
12.	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям подпункта 10) пункта 5 Правил, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
13.	Ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
14.	Негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
15.	Акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
16.	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или			

	рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери		100	
17.	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции эмитентов Республики Казахстан, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери		100	
18.	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции юридических лиц, включенные в сектор "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц, находящиеся в представительском списке индекса фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери		100	
19.	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющие международную рейтинговую оценку не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери		100	
20.	Аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты		100	
21.	Акции организаторов торгов с ценными бумагами и иных юридических лиц, являющихся частью инфраструктуры рынка ценных бумаг, акционерами которых являются профессиональные участники рынка ценных бумаг за вычетом резервов на возможные потери		100	
22.	Дебиторская задолженность (за вычетом резервов на возможные потери) организаций, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, за вычетом дебиторской задолженности работников и других лиц, не просроченная по условиям договора, в сумме, не превышающей десяти процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем		100	
23.	Основные средства управляющего инвестиционным портфелем в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем		100	
24.	Итого ликвидные активы (сумма строк 1-23) - ЛА		x	
25.	Обязательства по балансу		x	
26.	Минимальный размер собственного капитала (МРСК)	x	x	
27.	K1 "Норматив достаточности собственного капитала" ((строка 24-строка 25)/строка 26) не менее 1	x	x	

Таблица 2. Дополнительные сведения для расчета пруденциального норматива
(в тысячах тенге)

№ признака	Наименование показателей	Сумма по балансу
1	2	3

8001	Основные средства управляющего инвестиционным портфелем в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем	
8002	Прочие основные средства	
8003	Дебиторская задолженность (за вычетом резервов на возможные потери) организаций, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, за вычетом дебиторской задолженности работников и других лиц, не просроченная по условиям договора, в сумме, не превышающей 10 (десяти) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем	
8004	Прочая дебиторская задолженность (за вычетом резервов на возможные потери)	
8005	Аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты	
8006	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери при соответствии одному из следующих условий: банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzB" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств; банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "A-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	
8007	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери, при условии, что данные банки являются банками-эмитентами, включенными в сектор "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или банками-эмитентами, акции которых находятся в представительском списке индекса фондовой биржи	
8008	-	
8009	Вклады в банках-нерезидентах с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения, за вычетом резервов на возможные потери, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже категории "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	
8010	Деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан	
8011	Собственные деньги на счетах в центральной депозитарии	
8012	Собственные деньги на счетах в клиринговой организации, являющиеся гарантийными, маржевыми взносами управляющего инвестиционным портфелем	
8013	Деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах, которые имеют долгосрочный и (или) краткосрочный, индивидуальный рейтинг не ниже категории "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	
8014	Деньги на счетах в организациях-нерезидентах, предоставляющих банковские услуги организациям для осуществления операций на организованном рынке ценных бумаг	
8015	Деньги в кассе, не более 10 (десяти) процентов от суммы активов по балансу брокера и дилера	
8016	Прочие деньги	

8017	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8018	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8019	Акции юридических лиц Республики Казахстан, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери	
8020	Акции юридических лиц, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц, находящиеся в представительском списке индекса фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери	
8021	Акции юридических лиц, не отнесенные к акциям, указанным в признаке 8020 настоящего приложения, имеющие рейтинг не ниже "B-" за вычетом резервов на возможные потери	
8022	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющие рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8023	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, не являющихся по отношению к управляющему инвестиционным портфелем аффилированными лицами, имеющие рейтинговую оценку от "B+" до "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzB+" до "kzB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8024	Негосударственные долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку ниже уровня, указанного в признаках 8022 и 8023 настоящего приложения, а также не имеющие рейтинговую оценку, включенные в сектора "долговые ценные бумаги" официального списка фондовой биржи (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8025	Негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, не являющихся аффилированными лицами по отношению к управляющему инвестиционным портфелем, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям подпункта 10) пункта 5 Правил, (с	

	учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8026	Негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8027	Акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери	
8028	Акции организаторов торгов с ценными бумагами и иных юридических лиц, являющихся частью инфраструктуры рынка ценных бумаг, акционерами которых являются профессиональные участники рынка ценных бумаг за вычетом резервов на возможные потери	
8029	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери	
8030	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции эмитентов Республики Казахстан, имеющих рейтинговую оценку не ниже "BB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, за вычетом резервов на возможные потери	
8031	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции юридических лиц, включенные в сектор "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц, находящиеся в представительском списке индекса фондовой биржи, за вычетом резервов на возможные потери	
8032	Депозитарные расписки, базовым активом которых являются акции, указанные в признаке 8021 настоящего приложения за вычетом резервов на возможные потери	
8033	Ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "BBB-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8034	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющие международную рейтинговую оценку не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери	
8035	Другие ценные бумаги	

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

(фамилия, имя, отчество (при его наличии) _____ (подпись))

Главный бухгалтер _____
(фамилия, имя, отчество (при его наличии) _____ (подпись))

Исполнитель: _____
(должность, фамилия, имя, отчество (при его наличии) (подпись) (номер телефона))

Дата подписания отчета "_____" _____ 20__ года

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных, приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме расчета
пруденциального норматива

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных Расчет пруденциального норматива Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Расчет пруденциального норматива" (далее - Форма).
2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 6) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".
3. Форма заполняется ежемесячно на конец отчетного периода организацией, осуществляющей управление инвестиционным портфелем.
4. Единица измерения, используемая при заполнении Формы, устанавливается в тысячах тенге. Сумма менее 500 (пятисот) тенге округляется до 0 (нуля), а сумма, равная 500 (пятистам) тенге и выше, округляется до 1000 (одной тысячи) тенге.
5. Форму подписывает первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета, главный бухгалтер и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению расчета норматива достаточности собственного капитала

6. В столбце 3 Расчета норматива достаточности собственного капитала Таблицы 1 указываются данные на конец последнего календарного дня отчетного периода.
7. В столбце 5 Расчета норматива достаточности собственного капитала Таблицы 1 указывается сумма к расчету на конец последнего календарного дня отчетного периода, рассчитанная как произведение данных, указанных в столбцах 3 и 4.
8. В строке 30 указывается коэффициент достаточности собственного капитала, рассчитанный как отношение разницы ликвидных активов и обязательств по балансу к минимальному размеру собственного капитала.

Глава 3. Пояснение по заполнению дополнительных сведений для расчета пруденциального норматива

9. В столбце 3 Дополнительных сведений для расчета пруденциального норматива Таблицы 2 указываются данные на конец последнего календарного дня отчетного периода.

Приложение 2
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 3 февраля 2014 года № 7

Перечень

нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам
деятельности на рынке ценных бумаг,
в которые вносятся изменения и дополнения

1. Внести в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 октября 2008 года № 170 "Об утверждении Правил осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5406, опубликованное 14 января 2009 года в газете "Юридическая газета" № 5 (1602) следующие изменения:

в Правилах осуществления деятельности организатора торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, утвержденных указанным постановлением:

подпункт 18) пункта 1 изложить в следующей редакции:

"18) уполномоченный орган – Национальный Банк Республики Казахстан.";

пункт 37 изложить в следующей редакции:

"37. Операции "репо", осуществляемые в торговой системе фондовой биржи "автоматическим" способом, совершаются по:

1) государственным эмиссионным ценным бумагам Республики Казахстан, включая облигации местных исполнительных органов Республики Казахстан;

2) акциям, включенным в первую (наивысшую) категорию сектора "акции" официального списка фондовой биржи;

3) долговым ценным бумагам, имеющим минимальную рейтинговую оценку не ниже "B-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или минимальную рейтинговую оценку не ниже "kzB-" по национальной шкале Standard & Poor's или Fitch или не ниже kzB3 по национальной шкале Moody's Investors Service;

4) долговым ценным бумагам, включенным в категорию "долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки первой подкатегории" официального списка фондовой биржи;

5) акциям, находящимся в представительском списке индекса фондовой биржи.

Перечень ценных бумаг, которые являются предметом операций "репо", осуществляемых в торговой системе фондовой биржи "прямым" способом, устанавливается внутренними документами фондовой биржи."

2. Утратил силу постановлением Правления Национального Банка РК от 19.12.2015 № 249 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

3. Утратил силу постановлением Правления Национального Банка РК от 16.08.2019 № 133 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

4. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 апреля 2012 года № 165 "Об утверждении Инструкции к программно-техническим средствам и иному оборудованию, необходимым для

осуществления деятельности на рынке ценных бумаг" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7734, опубликованное 29 августа 2012 года в газете "Казахстанская правда" № 290-291 (27109-27110) следующие изменения:

в Инструкции к программно-техническим средствам и иному оборудованию, необходимым для осуществления деятельности на рынке ценных бумаг, утвержденной указанным постановлением:

преамбулу изложить в следующей редакции:

"Настоящая Инструкция к программно-техническим средствам и иному оборудованию, необходимым для осуществления деятельности на рынке ценных бумаг (далее - Инструкция), определяет требования к программно-техническим средствам и иному оборудованию, необходимым для осуществления деятельности на рынке ценных бумаг (далее - программное обеспечение), и организации безопасной работы, обеспечивающей сохранность и защиту информации от несанкционированного доступа к данным, хранящимся у профессиональных участников рынка ценных бумаг.

Действие Инструкции не распространяется на отношения, возникающие при использовании информационных ресурсов Национального Банка Республики Казахстан на основании соответствующего соглашения, заключенного между профессиональным участником рынка ценных бумаг и Национальным Банком Республики Казахстан.";

абзац тринадцатый подпункта 1) пункта 2 изложить в следующей редакции:

"составление и выдачу выписок с лицевого счета (субсчета) на определенную дату и время, отчетов о проведенных операциях, отчетов, уведомлений и справок по запросам держателей ценных бумаг, центрального депозитария, эмитентов и уполномоченного органа;"

5. Утратил силу постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 41 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

6. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 августа 2013 года № 214 "Об утверждении Правил формирования системы управления рисками и внутреннего контроля для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 8796, опубликованное 5 декабря 2013 года в газете "Юридическая газета" № 183 (2558) следующие изменения и дополнение:

в Правилах формирования системы управления рисками и внутреннего контроля для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем, утвержденных указанным постановлением:

преамбулу изложить в следующей редакции:

"Настоящие Правила формирования системы управления рисками для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем (далее - Правила) разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг" (далее - Закон о рынке ценных бумаг) и устанавливают порядок формирования системы управления рисками и внутреннего контроля для организаций, обладающих лицензией на осуществление брокерской и дилерской деятельности (далее - брокер и (или) дилер), деятельности по управлению инвестиционным портфелем (далее - Управляющий).

Требования к программно-техническому обеспечению, используемому для поддержания системы управления рисками, а также к автоматизации деятельности Управляющего, предусмотренные Правилами, не распространяют свое действие на отношения, возникающие при использовании информационных ресурсов Национального Банка Республики Казахстан на основании соответствующего соглашения, заключенного между Управляющим и Национальным Банком Республики Казахстан.";

пункт 1 изложить в следующей редакции:

"1. Целью Правил является определение требований к формированию у брокера и (или) дилера, Управляющего системы управления рисками.

Требования подпункта 3) пункта 42, подпунктов 4), 5), 6), и 7) пункта 43, пунктов 46, 48, 54, 55, 56 и 57 Правил не распространяются в отношении управления золотовалютными активами Национального Банка Республики Казахстан и активами Национального фонда Республики Казахстан, переданными в доверительное управление дочерней организации Национального Банка Республики Казахстан.";

пункты 8 и 9 изложить в следующей редакции:

"8. Стресс-тестинг по ценовому риску, процентному риску, валютному риску и риску ликвидности по собственным активам Управляющего и брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, и активам клиентов, принятым в инвестиционное управление, рассчитывается в соответствии с приложением 2 к Правилам, один раз в два месяца.

Результаты стресс-тестинга, оформляются в соответствии с приложением 2 к Правилам, не позднее пятого рабочего дня каждого четного месяца.

9. Информация по приложениям 3 и 4 к Правилам оформляется Управляющим и брокером и (или) дилером, являющимся Управляющим, не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.";

дополнить пунктом 9-1 следующего содержания:

"9-1. Управляющий, брокер и (или) дилер, являющийся Управляющим, обеспечивают резервирование и хранение информации, изложенной в пунктах 8 и 9 Правил на бумажном носителе и электронном формате.";

подпункт 9) пункта 20 изложить в следующей редакции:

"9) подготовке отчетности о результатах деятельности по управлению инвестиционным портфелем клиентов перед Национальным Банком Республики Казахстан, соответствующими органами, клиентами, активы которых приняты в управление;"

подпункт 6) пункта 21 изложить в следующей редакции:

"6) подготовке отчетности о результатах деятельности по управлению собственными активами перед Национальным Банком Республики Казахстан, соответствующими органами Управляющего или брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим.";

пункт 93 изложить в следующей редакции:

"93. Отчеты службы внутреннего аудита брокера и (или) дилера, Управляющего предоставляются Национальному Банку Республики Казахстан по его запросу.";

подпункт 5) пункта 96 изложить в следующей редакции:

"5) от подразделения информационного обеспечения брокера и (или) дилера, Управляющего раз в квартал информацию о:

состоянии аппаратно-программных технических комплексов;

технических проблемах, обнаруженных в течение отчетного периода;

выявленных несоответствиях внутренним процедурам брокера и (или) дилера, Управляющего;

мерах, принятых для устранения и предотвращения повторного возникновения проблем и несоответствий;

Информация, указанная в настоящем подпункте, не предоставляется при использовании информационных ресурсов Национального Банка Республики Казахстан на основании соответствующего соглашения, заключенного между Управляющим и Национальным Банком;"

7. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 августа 2013 года № 230 "Об утверждении перечня, форм, сроков и Правил представления отчетности организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем, брокерскую и (или) дилерскую деятельность" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 8857) следующее дополнение и изменение:

пункт 2 дополнить частью одиннадцатой следующего содержания:

"Золотовалютные активы уполномоченного органа и активы Национального фонда Республики Казахстан, переданные в доверительное управление, не указываются

управляющими инвестиционным портфелем при заполнении форм, установленных приложениями 6, 7, 8, 9, 15, 16, 17 и 18 к настоящему постановлению.";

в Правилах представления отчетности организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем, брокерскую и (или) дилерскую деятельность, утвержденных указанным постановлением:

пункт 6 изложить в следующей редакции:

"6. В случае необходимости внесения изменений и (или) дополнений в отчетность, Организация представляет в уполномоченный орган доработанную отчетность и письменное объяснение с указанием причин необходимости внесения изменений и (или) дополнений в отчетность."

Приложение 1
к Перечню нормативных правовых
актов Республики Казахстан по
вопросам деятельности на рынке
ценных бумаг, в которые
вносятся изменения и дополнения
"Приложение 1
к Правилам представления отчетности
клиринговыми организациями

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 16.08.2019 № 133 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 2
к Перечню нормативных правовых
актов Республики Казахстан по
вопросам деятельности на рынке
ценных бумаг, в которые
вносятся изменения и дополнения
"Приложение 1
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 27 мая 2013 года № 130

Сноска. Приложение 2 утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 41 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 3
к Перечню нормативных правовых
актов Республики Казахстан по
вопросам деятельности на рынке
ценных бумаг, в которые
вносятся изменения и дополнения
"Приложение 2
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 27 мая 2013 года № 130

Сноска. Приложение 3 утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 41 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 4
к Перечню нормативных правовых
актов Республики Казахстан по
вопросам деятельности на рынке
ценных бумаг, в которые
вносятся изменения и дополнения
"Приложение 3
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 27 мая 2013 года № 130

Сноска. Приложение 4 утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 41 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 3
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 3 февраля 2014 года № 7

Перечень

нормативных правовых актов Республики Казахстан, признаваемых утратившими силу

1. Постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 22 августа 2008 года № 122 "Об установлении пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем, утверждении Правил расчета пруденциального норматива для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5332, опубликованное 15 ноября 2008 года в Собрании актов центральных исполнительных и иных центральных государственных органов Республики Казахстан № 11).

2. Пункт 3 постановления Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 26 января 2009 года № 5 "О внесении дополнений и изменений в некоторые нормативные правовые акты Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций по вопросам пруденциального регулирования деятельности организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, организаций, осуществляющих деятельность по

ведению системы держателей ценных бумаг, организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем" (зарегистрированного в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5578).

3. Пункт 3 постановления Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 5 августа 2009 года № 185 "О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций по вопросам пруденциального регулирования деятельности организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, организаций, осуществляющих деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг, организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем" (зарегистрированного в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5777).

4. Пункт 3 постановления Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 декабря 2009 года № 265 "О внесении дополнений и изменений в некоторые нормативные правовые акты Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций по вопросам пруденциального регулирования деятельности организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, организаций, осуществляющих деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг, и организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем" (зарегистрированного в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 6039).

5. Пункт 20 перечня к постановлению Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 3 сентября 2010 года № 131 "О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам регулирования и надзора финансового рынка и финансовых организаций" (зарегистрированному в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 6554).

6. Пункт 5 приложения к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 января 2012 года № 20 "О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан" (зарегистрированному в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под 7439, опубликованному 24 мая 2012 года в газете "Казахстанская правда" № 150-151 (26969-26970)).