

О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам регулирования и надзора финансового рынка и финансовых организаций

Утративший силу

Постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 4 октября 2010 года № 150. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 9 ноября 2010 года № 6632. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 августа 2013 года № 214

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 27.08.2013 № 214 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

В целях совершенствования нормативных правовых актов Правление Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - Агентство) **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. **Утратил силу постановлением Правления Национального Банка РК от 24.02.2012 № 76 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).**

2. Внести в постановление Правления Агентства от 26 сентября 2009 года № 209 "Об утверждении Инструкции о требованиях по наличию системы управления рисками для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем, и внесении изменений в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 21 апреля 2003 года № 137 "Об утверждении Правил осуществления деятельности по управлению инвестиционным портфелем" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5844) следующие изменения и дополнения:

наименование постановления изложить в следующей редакции:

"Об утверждении Инструкции о требованиях по наличию системы управления рисками для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем";

в Инструкцию о требованиях по наличию системы управления рисками для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке

ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем, утвержденную указанным постановлением:

пункт 1 дополнить словами ", за исключением организаций, совмещающих вышеуказанные виды деятельности с деятельностью по осуществлению инвестиционного управления пенсионными активами, а также банков второго уровня";

дополнить пунктом 1-1 следующего содержания:

"1-1. Банки второго уровня, осуществляющие брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, формируют систему управления рисками в соответствии с Инструкцией о требованиях к наличию систем управления рисками и внутреннего контроля в банках второго уровня, утвержденной постановлением правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 30 сентября 2005 года № 359 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3925).";

в пункте 3:

подпункт 8) изложить в следующей редакции:

"8) гэп - позиция - разница между активами клиента и обязательствами по активам клиента, переданным в инвестиционное управление либо на брокерское обслуживание, в зависимости от сроков исполнения данных обязательств, или разница между собственными ликвидными активами и обязательствами Брокера и (или) дилера, Управляющего в зависимости от сроков исполнения данных обязательств";

подпункт 13) изложить в следующей редакции:

"13) контрапартнер - юридическое лицо, оказывающее услуги Брокеру и (или) дилеру, Управляющему в процессе заключения сделок с финансовыми инструментами, совершаемых за счет активов клиентов и (или) собственных активов Брокера и (или) дилера, Управляющего, обладающее лицензией либо разрешением, предоставляющими право на совершение сделок с финансовыми инструментами, полученными в соответствии с законодательством государства, на территории которого данное юридическое лицо зарегистрировано в качестве юридического лица";

дополнить подпунктом 17-1) следующего содержания:

"17-1) управление конфликтом интересов - создание механизмов недопущения ситуаций, при которых интересы должностного лица или работника Брокера и (или) дилера, Управляющего могут повлиять на объективность и независимость принятия ими решений и исполнения обязанностей, а также вступить в противоречие с их обязательством действовать в интересах клиентов Брокера и (или) дилера, Управляющего и (или) акционеров

Брокера и (или) дилера, Управляющего";
подпункт 26) изложить в следующей редакции:

"26) лимиты "take profit" - предельно допустимый уровень доходов по операциям с финансовыми инструментами";

п у н к т 8 :

абзац седьмой подпункта 3) изложить в следующей редакции:

"процедуры, направленные на предотвращение случаев неправомерного использования средств клиентов";

в подпункте 7) знак препинания "." заменить знаком препинания ";";

дополнить подпунктом 8) следующего содержания:

"8) управление существующим и потенциальным конфликтом интересов в Брокере и (или) дилере. ";

п у н к т 9 :

абзац пятый подпункта 7) изложить в следующей редакции:

"процедуры, направленные на предотвращение случаев неправомерного использования средств клиентов";

в подпункте 12) знак препинания "." заменить знаком препинания ";";

дополнить подпунктом 13) следующего содержания:

"13) управление существующим и потенциальным конфликтом интересов в Управляющем. ";

пункт 11 дополнить подпунктом 11-1) следующего содержания:

"11-1) политика управления существующим и потенциальным конфликтом интересов ; " ;

в п у н к т е 16 :

абзац шестой подпункта 3) исключить;
в подпункте 6) слова "должностных лиц" заменить словами "должностей руководящих работников";

в подпункте 5) пункта 17 слова "должностных лиц" заменить словами "должностей руководящих работников";

в подпункте 5) пункта 18 слова "должностных лиц" заменить словами "должностей руководящих работников";

в п о д п у н к т е 5) п у н к т а 20 :

с л о в о " в с е х " и с к л ю ч и т ь ;

после слова "деятельности" дополнить словами ", перечень которых определяется внутренними документами Брокера и (или) дилера, Управляющего"
;

дополнить пунктом 26-1 следующего содержания:

"26-1. Политика управления существующим и потенциальным конфликтом интересов , в к л ю ч а е т :

1) определение ситуаций, при которых интересы должностного лица или работника Брокера и (или) дилера, Управляющего могут повлиять на объективность и независимость принятия ими решений и исполнения обязанностей, а также вступить в противоречие с их обязательством действовать в интересах клиентов Брокера и (или) дилера, Управляющего и (или) акционеров Брокера и (или) дилера, Управляющего;

2) принципы деятельности должностных лиц и работников Брокера и (или) дилера, Управляющего при возникновении ситуаций, указанных в подпункте 1) настоящего пункта Инструкции;

3) порядок осуществления сбора, хранения и мониторинга сведений в целях выявления и описания ситуаций, указанных в подпункте 1) настоящего пункта Инструкции, в процессе деятельности органов, подразделений, должностных лиц и работников Брокера и (или) дилера, Управляющего;

4) процедуры принятия решений органами Брокера и (или) дилера, Управляющего, направленные на обеспечение независимости и объективности принимаемых решений, включая ограничение права участия в принятии решений должностных лиц и работников Брокера и (или) дилера, Управляющего, при возникновении ситуаций, указанных в подпункте 1) настоящего пункта Инструкции. " ;

в подпункте 3) пункта 27 слова "должностных лиц" заменить словами "должностей руководящих работников";

пункт 32 изложить в следующей редакции:

"32. В целях обеспечения эффективного управления активами клиентов, принятых в управление, в том числе активами инвестиционных фондов, и (или) собственными активами Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, ответственным подразделением Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, в функции которого включаются сбор, обработка и анализ информации, необходимой для принятия решения о заключении сделок с финансовыми инструментами за счет собственных средств и активов клиентов, принятых в инвестиционное управление, проводятся :

1) не реже одного раза в полугодие:
макроэкономический анализ по степени привлекательности рынков инвестирования в зависимости от складывающейся геополитической ситуации, валюты инвестирования и отрасли экономики;

2) не реже одного раза в квартал:
анализ эмитентов и выпущенных (предоставленных) ими финансовых инструментов, включая анализ финансового состояния эмитента, способности отвечать по принятым обязательствам, рисков, связанных с инвестированием в

финансовые инструменты данного эмитента и, в случае инвестирования собственных активов, влиянием данных рисков на значения пруденциальных нормативов и иных норм и лимитов, установленных уполномоченным органом для

У п р а в л я ю щ е г о ;

анализ инвестиционного портфеля, включающий сведения о структуре портфеля, динамике изменения доходности, анализ убыточных позиций и предложения по оптимизации структуры портфеля;

анализ, содержащий прогноз размера активов, предполагаемых к принятию в инвестиционное управление, а также структуры обязательств инвестиционного(-ых) портфеля(-ей), принятого(-ых) в управление, по срокам их исполнения (на основе анализа структуры клиентов, в том числе пайщиков, акционеров инвестиционного фонда, включающего информацию о сумме денег и (или) активов, переданных в инвестиционное управление);

3) на ежедневной основе :

управление денежными потоками (ликвидностью), включающее обзор соблюдения лимитов гэп-позиций по собственным активам и активам клиентов, с учетом изменения способности мобилизовать ликвидные активы, необходимые для погашения обязательств в течение установленных сроков, в том числе мониторинг способности сформировать ликвидные активы в иностранной валюте, необходимые для погашения обязательств в иностранной валюте.";

в подпункте 3) пункта 37 слова "на основании информации, представляемой подразделением, осуществляющим управление активами клиентов и (или) собственными активами," исключить;

в подпункте 2) пункта 39 абзац двенадцатый изложить в следующей редакции :

"лимиты гэп-позиций на основании ежеквартально проводимого подразделением, осуществляющим управление рисками, анализа гэп - позиций,";

п у н к т 4 2 :

абзац шестой изложить в следующей редакции:

"мнения членов инвестиционного комитета с обоснованием, в том числе в случае их несогласия с принятым решением, и наличия мнения (выраженного при принятии решения), отличного от принятого инвестиционного решения,";

дополнить абзацем седьмым следующего содержания:

"сведения о возникновении ситуаций, указанных в подпункте 1) пункта 26-1 настоящей Инструкции.";

в подпункте 4) пункта 46 слово "национальный" исключить;

в п у н к т е 5 1 :

в абзаце первом слова "осуществляющим управление рисками" заменить словами "ответственным за анализ структуры портфеля";

абзац четвертый изложить в следующей редакции:
"проведения мониторинга соблюдения лимита гэп-позиций.";

пункт 54 изложить в следующей редакции:

"54. Обеспечение мониторинга правовых рисков в инвестиционной деятельности Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, осуществляется посредством проведения следующих действий:

1) подразделение, осуществляющее управление рисками, на постоянной основе контролирует выполнение ответственными подразделениями пруденциальных нормативов и норм диверсификации, установленных уполномоченным органом;

2) подразделение, осуществляющее функции правового обеспечения: осуществляет контроль за соответствием деятельности Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, требованиям законодательства Республики Казахстан посредством проведения правовой экспертизы проектов договоров и документов, связанных с договорами, проектов внутренних документов Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, в том числе касающихся проведения операций с финансовыми инструментами;

на постоянной основе обеспечивает ознакомление персонала с изменениями в законодательстве Республики Казахстан, регулирующем деятельность Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим;

3) ответственные структурные подразделения Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим, проводят: оценку возможности появления дополнительных рисков, связанных с изменением в законодательстве Республики Казахстан, регулирующем деятельность Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим;

осуществляют ознакомление персонала с внутренними документами Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим;

обеспечивают соблюдение Управляющим или Брокером и (или) дилером, являющимся Управляющим, договорных отношений и осуществляют контроль соблюдения контрапартнерами своих обязательств.";

подпункт б) пункта 57 изложить в следующей редакции:

"б) возникновение ситуаций, указанных в подпункте 1) пункта 26-1 настоящей Инструкции";

подпункт 4) пункта 66 изложить в следующей редакции:

"4) двухуровневый контроль операций, осуществляемых Брокером и (или) дилером, Управляющим в рамках лицензируемых видов деятельности";

в подпункте 1) пункта 76 слова "бухгалтерский учет" заменить словами "

анализ и планирование бюджета";
в подпункте 1) пункта 78 слова "бухгалтерский учет" заменить словами "

анализ и планирование бюджета";
в п у н к т е 8 0 :

подпункт 1) изложить в следующей редакции:

"1) от подразделения, осуществляющего управление активами клиентов (инвестиционных фондов), принятых в инвестиционное управление, и (или) собственными активами:

макроэкономический анализ по степени привлекательности рынков инвестирования в зависимости от складывающейся геополитической ситуации, валюты инвестирования и сектора экономики - не реже одного раза в полугодие;

анализ эмитентов и выпущенных (предоставленных) ими финансовых инструментов, включая анализ финансового состояния эмитентов, способности отвечать по принятым обязательствам, рисков, связанных с инвестированием в финансовые инструменты данных эмитентов, - не реже одного раз в квартал;

анализ инвестиционного портфеля, включающий сведения о структуре портфеля, динамике изменения доходности, анализ убыточных позиций и предложения по оптимизации структуры портфеля - не реже одного раза в к в а р т а л ;

анализ, содержащий прогноз размера активов, предполагаемых к принятию в инвестиционное управление, а также структуры обязательств инвестиционного(-ых) портфеля(-ей), принятого(-ых) в управление, по срокам их исполнения (на основе анализа структуры клиентов, в том числе пайщиков, акционеров инвестиционного фонда, включающего информацию о сумме денег и (или) активов, переданных в инвестиционное управление), - не реже одного раза в к в а р т а л ;

информацию по управлению денежными потоками (ликвидностью), включающую обзор соблюдения лимитов гэп-позиций, с учетом изменения способности мобилизовать ликвидные активы, необходимые для погашения обязательств в течение установленных сроков, в том числе мониторинг способности сформировать ликвидные активы в иностранной валюте, необходимые для погашения обязательств в иностранной валюте - на е ж е д н е в н о й о с н о в е ;

отчет об обнаружении негативной информации о деятельности контрапартнеров и клиентов - по мере обнаружения;

мониторинг финансового состояния эмитента, а также отчеты о появлении информации, которая оказывает влияние на стоимость финансовых инструментов эмитента или способность исполнять им свои обязательства - не реже одного раза в квартал";

абзац пятый подпункта 2) изложить в следующей редакции:

"лимиты гэп-позиции на основании анализа, проводимого подразделением, осуществляющим управление рисками, - не реже одного раза в квартал;"

в п у н к т е 8 2 :

абзац третий подпункта 1) изложить в следующей редакции:

"информацию о соблюдении (использовании) установленных лимитов "stop - loss" и "take - profit" - на еженедельной основе в соответствии с приложением 4 к настоящей Инструкции;"

подпункт 3) дополнить абзацем третьим следующего содержания:

"информацию о структуре портфеля - на ежедневной основе;"

в п р и л о ж е н и и 2 :

после формы 1 слова "Брокером и (или) дилером, Управляющим" заменить словами "Управляющим или Брокером и (или) дилером, являющимся Управляющим";

слова "Первый руководитель Брокера и (или) дилера, Управляющего" заменить словами "Первый руководитель Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим";

после формы 2, 3 слова "Первый руководитель Брокера и (или) дилера, Управляющего" заменить словами "Первый руководитель Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим";

приложение 3 изложить в редакции согласно приложению 3 к настоящему постановлению;

дополнить приложением 4 согласно приложению 4 к настоящему постановлению.

3. Настоящее постановление вводится в действие по истечении четырнадцати календарных дней со дня его государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан.

4. Организациям, осуществляющим брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем, в срок до 1 декабря 2010 года привести свои внутренние документы в соответствие с требованиями настоящего постановления.

5. Департаменту надзора за субъектами рынка ценных бумаг и накопительными пенсионными фондами (Хаджиева М.Ж.):

1) совместно с Юридическим департаментом (Сарсенова Н.В.) принять меры к государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан настоящего постановления;

2) в десятидневный срок со дня государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан довести настоящее постановление

до сведения заинтересованных подразделений Агентства, Объединения юридических лиц "Ассоциация финансистов Казахстана", "Национальная экономическая палата Казахстана "Союз "Атамекен".

6. Службе Председателя Агентства (Кенже А.А.) принять меры по опубликованию настоящего постановления в средствах массовой информации Республики Казахстан.

7. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Агентства Алдамберген А.У.

Председатель Е. Бахмутова

Приложение 1

к постановлению Правления

Агентства Республики Казахстан

по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций

от 4 октября 2010 года № 150

Сноска. Приложение 1 утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 24.02.2012 № 76 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 2

к постановлению Правления

Агентства Республики Казахстан

по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций

от 4 октября 2010 года № 150

Сноска. Приложение 2 утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 24.02.2012 № 76 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

Приложение 3

к постановлению Правления

Агентства Республики Казахстан

по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций

от 4 октября 2010 года № 150

" Приложение 3

к Инструкции о требованиях по наличию

системы управления рисками для

организаций, осуществляющих брокерскую

и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем

Отчет о соблюдении (использовании) установленных лимитов инвестирования
" _____ "

(наименование Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим)

за период с _____ по _____

Классификация инвестиций	Размер инвестирования	
	Установленный лимит	Фактический размер инвестирования
По стране		
По валюте		
По сектору экономики		
По эмитенту		
По виду финансового инструмента		
Итого		

Первый руководитель (либо лицо, его замещающее)

подпись дата

Руководитель подразделения, осуществляющего управление рисками

подпись дата

Руководитель службы внутреннего аудита

подпись дата

П р и м е ч а н и е :

Отчет представляется отдельно по активам каждого клиента, принятым в инвестиционное управление, и собственным активам."

П р и л о ж е н и е 4

к постановлению Правления

Агентства Республики Казахстан

по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций

от 4 октября 2010 года № 150

" **П р и л о ж е н и е 4**

к Инструкции о требованиях по наличию системы управления рисками для

организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, деятельность по управлению инвестиционным портфелем

Отчет о соблюдении (использовании) установленных лимитов "stop - loss" и "take - profit"

" _____ "

(наименование Управляющего или Брокера и (или) дилера, являющегося Управляющим)

за период с _____ по _____

Финансовый инструмент	Установленный лимит "stop loss"	Установленный лимит "take profit"	Понесенные убытки в случае превышения лимита	Предпринятые меры в случае превышения лимита
Итого				

Первый руководитель (либо лицо, его замещающее)

подпись дата

Руководитель подразделения, осуществляющего управление рисками

подпись дата

Руководитель службы внутреннего аудита

подпись дата

П р и м е ч а н и е :

Отчет представляется отдельно по активам каждого клиента, принятым в инвестиционное управление, и по собственным активам.

В графе "Понесенные убытки в случае превышения лимита" указываются убытки с учетом полученных доходов."