

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі
Национальный Банк Республики Казахстан
National Bank of Kazakhstan



ВЕСТНИК

Национального Банка Казахстана

- 1 Пресс-релизы
- 2 Официальные курсы иностранных валют
- 3 Текущее состояние финансового сектора экономики Казахстана
- 11 Нормативные правовые акты

№ 22
16 – 30 ноября 2011

«Вестник Национального Банка Казахстана»,

Редактор:

Акишев Д.Т. – заместитель Председателя Национального Банка Республики Казахстан;

заместитель редактора:

Терентьев А. Л. – директор Департамента организационной работы,
внешних и общественных связей;

члены совета:

Орлов П.Е. – начальник управления мониторинга предприятий Департамента
исследований и статистики;

Дюгай Н. Н. – директор Департамента платежного баланса и валютного регулирования;

Нажимеденова С.Ж. – начальник отдела переводов и внедрения государственного языка
Департамента по работе с персоналом;

ответственная за выпуск:

Жетибаева М.Б. – эксперт управления общественных связей Департамента
организационной работы, внешних и общественных связей.

Учредитель – Национальный Банк Казахстана

Издание зарегистрировано в Национальном агентстве по делам печати и массовой информации РК
под № 432 от 24.02.1997 г.

Национальный Банк Казахстана

Издается с 1995 года

ТОО "Caspian Media Group"
050044, г. Алматы,
пр-т Жибек Жолы, 50
тел. +7 (727) 3341526 (27)

**НАЦИОНАЛЬНЫЙ БАНК
РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН**

**ПРЕСС-РЕЛИЗ №39
22 ноября 2011 года**

**О продлении Конкурса на лучший дизайн монеты и
об установлении денежных призов**

По многочисленным просьбам, поступающим в адрес Национального Банка Республики Казахстан, Конкурс на лучший дизайн монеты продлевается **до 10 декабря 2011 года**.

Напоминаем, что Конкурс проводится на тему «Мой Казахстан» по двум номинациям – «Народная монета» и «Детская монета».

В соответствии с Постановлением Совета директоров Национального Банка Республики Казахстан от 18 ноября 2011 года № 226 «Об установлении призового фонда конкурса на лучший дизайн монеты, посвященного празднованию 20-летия Независимости Республики Казахстан», сумма денежного приза победителю Конкурса в номинации «Народная монета», составляет **750 000 (семьсот пятьдесят тысяч) тенге**, и по номинации «Детская монета» - **500 000 (пятьсот тысяч) тенге**.

Проекты дизайнов монет, представленные на Конкурс, будут рассматриваться Конкурсной комиссией, в которую вошли известные общественные и политические деятели, ведущие финансисты, представители творческой интеллигенции страны.

В номинации «Народная монета» Конкурсной комиссией будут отобраны 20 лучших работ для их дальнейшей оценки пользователями Интернет методом online-голосования. Проект дизайнера, получивший наибольшее число голосов, получит Приз зрительских симпатий.

Подведение итогов Конкурса планируется 15 декабря 2011 года.

Заявки на участие и конкурсные работы как на бумажном (запечатанные в конверты), так и на электронном носителе, направляются по адресу: 050040, г. Алматы, мкр. Коктем-3, дом 21, Департамент организационной работы, внешних и общественных связей Национального Банка Республики Казахстан. Положение о Конкурсе на лучший дизайн монеты и заявка на участие размещены на Форуме Национального Банка Республики Казахстан на Интернет-ресурсе www.profinance.kz

Официальные обменные курсы иностранных валют в 2011 году

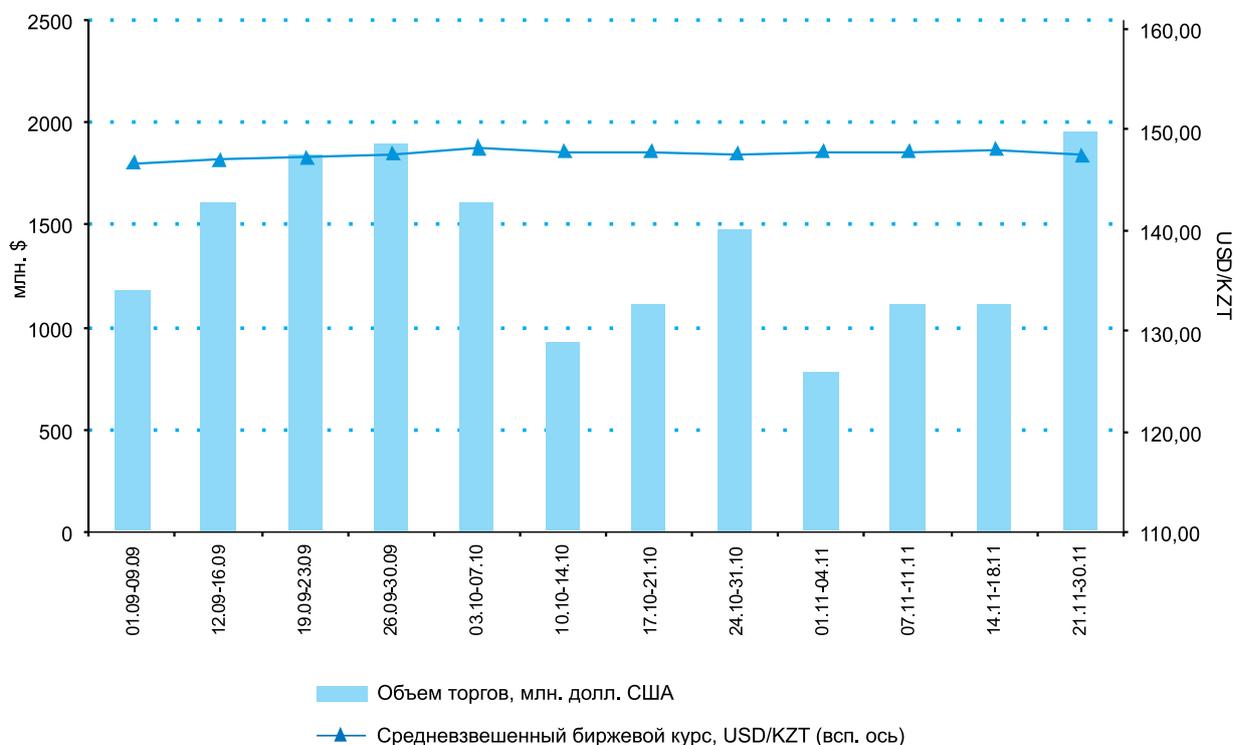
	16/11	17/11	18/11	19-21/11	22/11	23/11	24/11	25/11	26-28/11	29/11	30/11	Ноябрь	
Австралийск. доллар	AUD	150,61	150,24	149,18	147,86	146,72	145,78	143,79	143,40	142,47	145,75	146,88	149,61
Англ. фунт стерл.	GBP	235,51	233,95	233,06	233,99	232,28	231,18	229,38	228,78	227,57	228,84	229,60	233,99
Белорусский рубль	BYR	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02
Венгерский форинт	HUF	0,64	0,64	0,64	0,65	0,65	0,66	0,65	0,64	0,62	0,64	0,64	0,65
Датская крона	DKK	27,04	26,93	26,81	26,88	26,75	26,83	26,65	26,50	26,28	26,50	26,46	27,02
Дирам ОАЭ	AED	40,36	40,32	40,30	40,30	40,28	40,18	40,12	40,08	40,09	40,15	40,22	40,26
Доллар США	USD	148,22	148,08	148,01	148,02	147,95	147,57	147,34	147,20	147,23	147,48	147,72	147,85
Евро	EUR	201,19	200,37	199,55	199,99	199,07	199,63	198,25	197,04	195,34	197,05	196,79	201,02
Канадский доллар	CAD	145,27	144,61	144,63	143,92	143,33	142,22	141,52	140,73	140,30	142,30	142,78	144,38
Китайский юань	CNY	23,35	23,34	23,31	23,29	23,26	23,20	23,18	23,14	23,08	23,10	23,16	23,27
Кувейтский динар	KWD	539,37	535,94	536,27	536,30	536,05	534,48	533,26	533,33	531,71	532,61	533,48	536,26
Кыргызский сом	KGS	3,21	3,21	3,21	3,18	3,17	3,17	3,16	3,15	3,15	3,23	3,16	3,21
Латвийский лат	LVL	287,58	286,26	284,47	284,93	283,37	283,19	280,97	282,59	280,06	282,64	282,39	286,71
Литовский лит	LTL	58,29	58,05	57,81	57,94	57,66	57,85	57,43	57,09	56,59	57,06	57,01	58,23
Молдавский лей	MDL	12,71	12,63	12,64	12,64	12,64	12,56	12,50	12,40	12,38	12,44	12,52	12,67
Норвежская крона	NOK	25,84	25,75	25,60	25,55	25,46	25,54	25,40	25,24	24,94	25,17	25,08	25,86
Польский злотый	PLN	45,68	45,36	45,01	45,13	44,90	44,96	44,56	44,06	43,27	43,64	43,52	45,50
Риял Саудовской Аравии	SAR	39,52	39,48	39,47	39,47	39,45	39,35	39,29	39,25	39,26	39,33	39,39	39,43
Российский рубль	RUB	4,83	4,83	4,81	4,79	4,77	4,76	4,72	4,69	4,66	4,71	4,71	4,80
СДР	XDR	233,02	231,89	231,19	231,16	232,17	230,22	230,50	229,07	229,12	229,51	229,56	231,98
Сингап. доллар	SGD	114,78	114,61	114,58	114,20	113,88	113,52	113,01	112,62	112,03	113,32	113,65	114,92
Таджикский сомони	TJS	31,17	31,13	31,11	31,10	31,07	30,99	30,96	30,93	30,94	30,99	31,04	31,08
1 турецкая лира	TRY	83,13	82,38	82,05	81,51	80,63	80,29	79,47	78,90	78,29	79,21	79,42	81,93
Узбекский сум	UZS	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08
Украинская гривна	UAH	18,48	18,52	18,46	18,48	18,50	18,48	18,43	18,38	18,37	18,41	18,42	18,46
Чешская крона	CZK	7,80	7,80	7,79	7,84	7,80	7,83	7,75	7,68	7,55	7,61	7,69	7,91
Шведская крона	SEK	22,02	21,96	21,82	21,85	21,73	21,71	21,48	21,39	21,10	21,30	21,31	22,03
Швейцарский франк	CHF	162,26	161,57	160,64	161,82	160,90	161,70	161,20	160,37	159,08	159,64	160,04	163,25
Южно-африканский ранд	ZAR	18,33	18,11	18,12	18,09	17,94	17,83	17,47	17,27	17,24	17,65	17,72	18,22
100 Южно-корейских вон	KRW	13,15	13,05	13,07	13,00	12,95	12,91	12,81	12,71	12,64	12,79	12,88	13,06
1 японская йена	JPY	1,92	1,92	1,92	1,93	1,93	1,92	1,91	1,91	1,90	1,90	1,90	1,91

ТЕКУЩЕЕ СОСТОЯНИЕ ФИНАНСОВОГО СЕКТОРА ЭКОНОМИКИ КАЗАХСТАНА

1. ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК

	Официальный курс на конец периода	Средневзвешенный биржевой курс, за период		Объем торгов на Казахстанской фондовой бирже
	USD/KZT	USD/KZT	%*	млн. \$
01.11-04.11	147.91	147.96	1.19	782.05
07.11-11.11	148.08	148.03	0.04	1116.80
14.11-18.11	148.01	148.10	0.07	1107.10
14.11.2011	148.13	148.14	0.01	265.90
15.11.2011	148.14	148.22	0.05	184.80
16.11.2011	148.22	148.08	-0.09	302.65
17.11.2011	148.08	148.01	-0.05	191.95
18.11.2011	148.01	148.02	0.01	161.80
21.11-30.11	147.72	147.49	-0.41	1955.90
21.11.2011	148.02	147.95	-0.05	161.55
22.11.2011	147.95	147.57	-0.26	469.50
23.11.2011	147.57	147.34	-0.16	489.65
24.11.2011	147.34	147.20	-0.10	241.85
25.11.2011	147.20	147.23	0.02	146.20
28.11.2011	147.23	147.48	0.17	147.25
29.11.2011	147.48	147.72	0.16	105.40
30.11.2011	147.72	147.69	-0.02	194.50

* - изменения к предыдущему периоду.

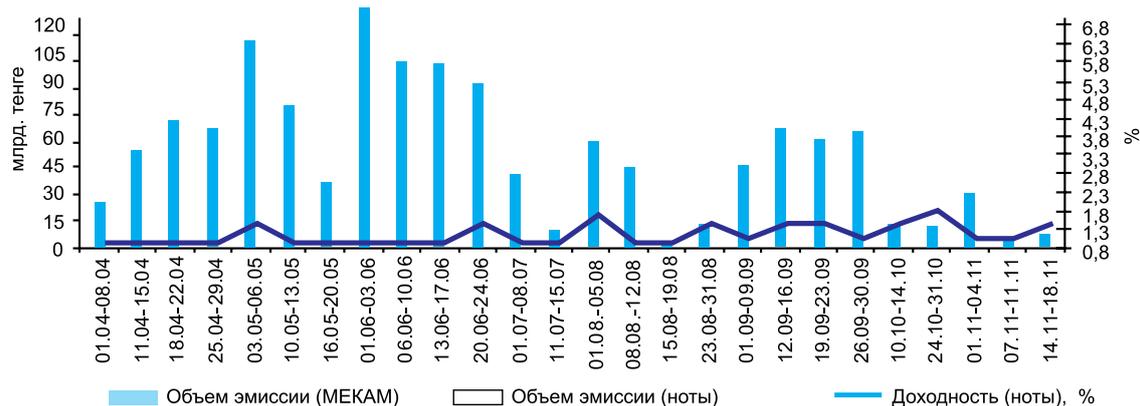


2. РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ

Первичный рынок государственных ценных бумаг

	превышение спроса над предложением, раз	удовлетворение спроса, %	средневзвешенная эффективная доходность за период, %	объем удовлетворенного спроса, млрд. тенге
ГЦБ Минфина				
10.10-14.10	2.4	65.1	2.01	21.7
17.10-21.10	2.9	35.6	5.3	15.3
24.10-31.10	9.7	12.7	Инф+0,01%	16.0
01.11-04.11	1.15	40.2	1.66	5.6
07.11-11.11	3.6	27.6	3.02	10.0
14.11-18.11	2.4	41.0	5.0	17.0
21.11-30.11	12.5	1.12	Инф+0,01%	1.4
Ноты Национального Банка Республики Казахстан				
26.09-30.09	1.07	100	1.01	64.6
03.10-07.10	-	-	-	-
10.10-14.10	0.2	100	1.46	12.9
17.10-21.10	-	-	-	-
24.10-31.10	0.3	52.6	1,75	10.9
01.11-04.11	0.5	100	1.01	30.0
07.11-11.11	0.01	100	1.01	5.2
14.11-18.11	0,12	100	1,46	7,5
21.11-30.11	-	-	-	-

Рынок ГЦБ, номинированных в тенге



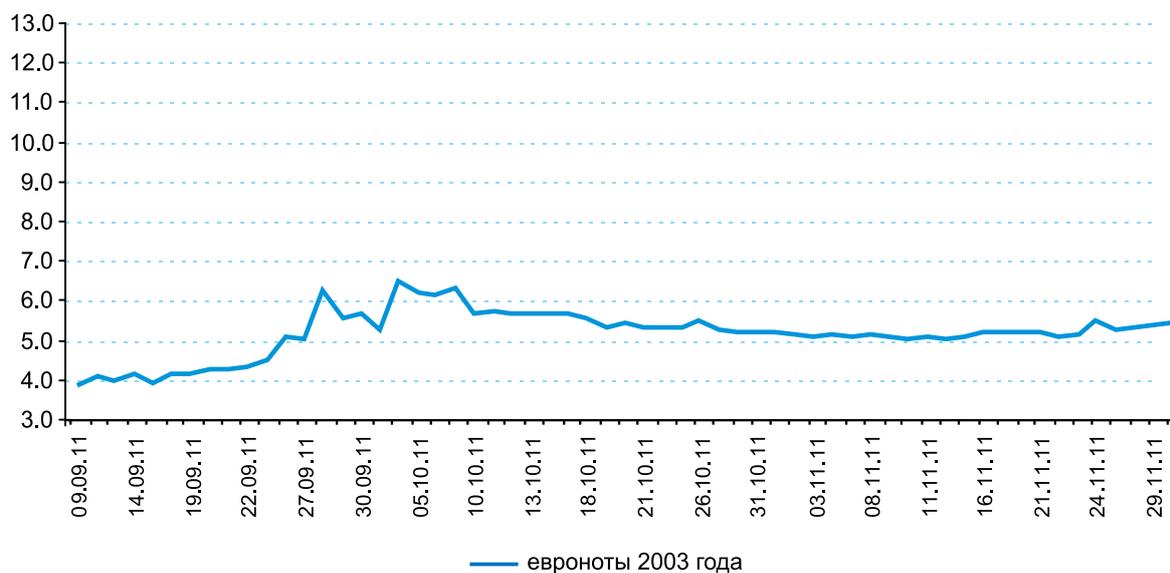
Государственные ценные бумаги в обращении (по дисконтированной стоимости)

	Объем млн. тенге				
	Всего	в т.ч. ГЦБ Минфина			в т.ч. ноты НБК
		долгосрочные	среднесрочные	краткосрочные	
14.10.11	2 672 365,14	1 352 177,69	487 935,94	86 077,21	746 174,30
21.10.11	2 633 077,40	1 366 949,02	487 948,86	86 093,87	692 085,64
31.10.11	2 606 859,23	1 382 949,02	487 939,18	87 717,57	648 253,47
04.11.11	2 525 599,22	1 382 949,02	487 950,15	93 294,80	561 405,25
11.11.11	2 496 433,46	1 382 949,02	497 962,42	93 294,80	522 227,21
18.11.11	2 493 709,66	1 399 949,02	482 158,12	83 477,35	528 125,18
30.11.11	2 470 629,97	1 403 359,02	482 136,97	83 477,35	501 656,64

3. РЫНОК КАЗАХСТАНСКИХ ЕВРОНОТ

	Выпуск 2003г.
Доходность при выпуске	7,637
21.11.2011	5.191
22.11.2011	5.112
23.11.2011	5.158
24.11.2011	5.508
25.11.2011	5.300
28.11.2011	5.385
29.11.2011	5.405
30.11.2011	5.455
с начала эмиссии	-2,18
за неделю	0,26

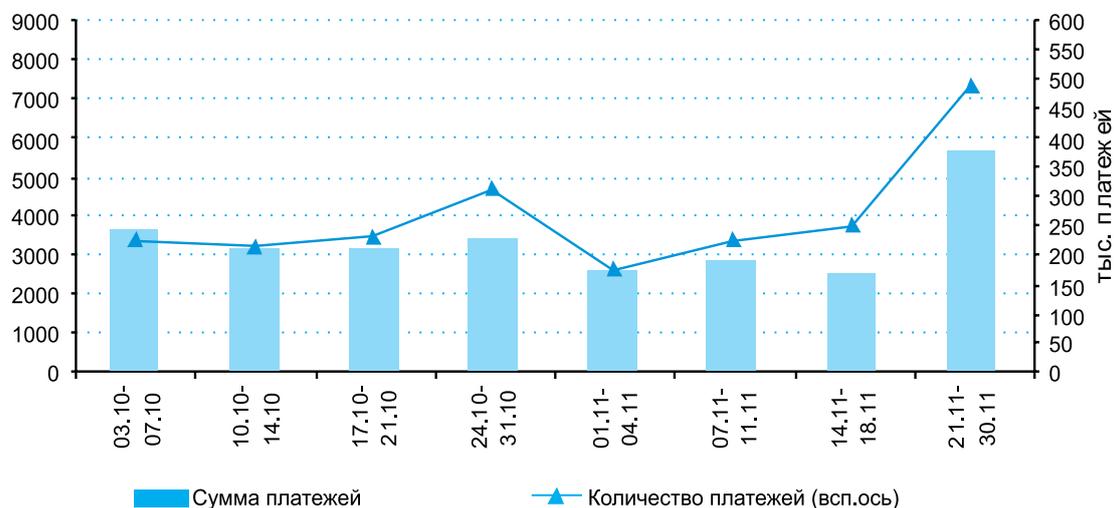
Динамика доходности казахстанских евронот, %



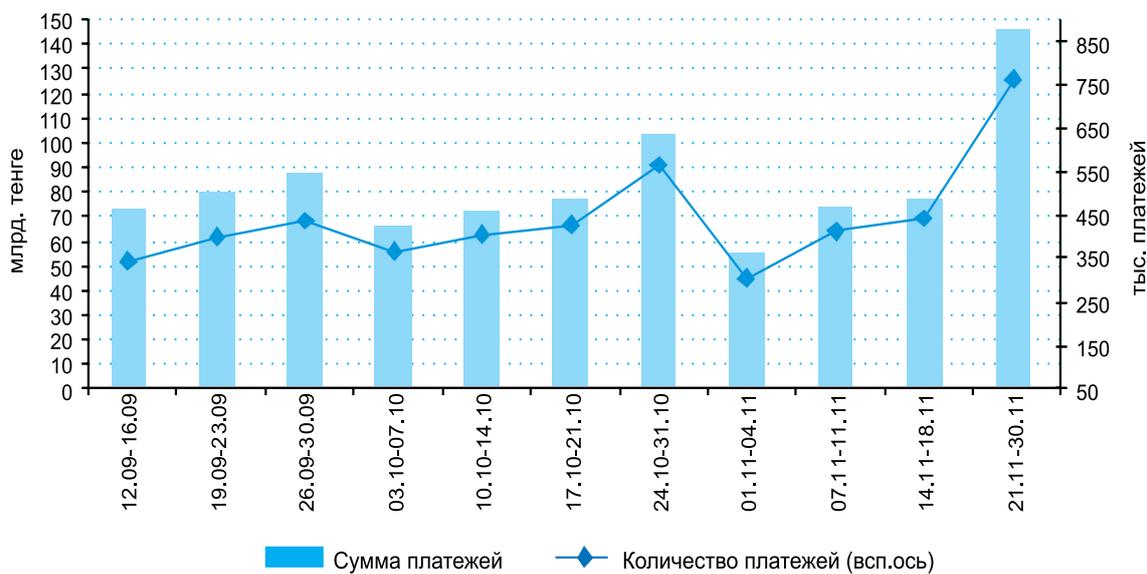
4. ПЛАТЕЖНЫЕ СИСТЕМЫ

	МСПД			СРП		
	Кол-во, тыс.	Объем, млрд. тенге	Изменение объема, %	Кол-во, тыс.	Объем, млрд. тенге	Изменение объема, %
14.11-18.11	245,7	2501,5	13,4	436,0	76,7	-4,4
21.11-30.11	488,7	5621,8	124,7	759,8	144,6	88,5

Межбанковская система переводов денег



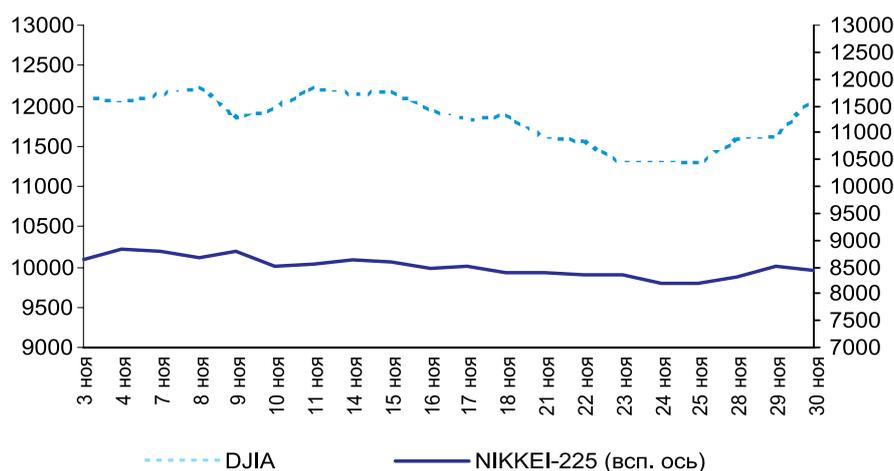
Система розничных платежей



5. МИРОВЫЕ ФИНАНСОВЫЕ И ТОВАРНЫЕ РЫНКИ

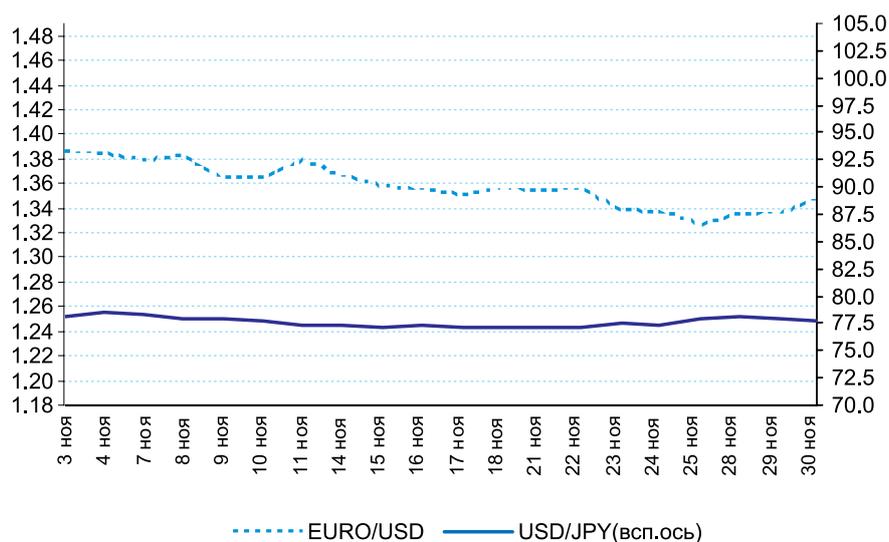
Биржа	Индекс	Значение в пунктах		Изменение	
		18.11.2011	30.11.2011	за период	с дек. 01г.
США	Dow Jones	11 796,16	12 045,68	2,12%	18,83%
Япония	Nikkei 225	8 374,91	8 434,61	0,71%	-20,00%
Германия	DAX	5 800,24	6 088,84	4,98%	18,00%
Великобритания	FTSE	5 362,94	5 505,42	2,66%	5,90%
Гонконг	Hang Seng	18 491,23	17 989,35	-2,71%	57,37%

Динамика индексов Dow Jones и Nikkei 225



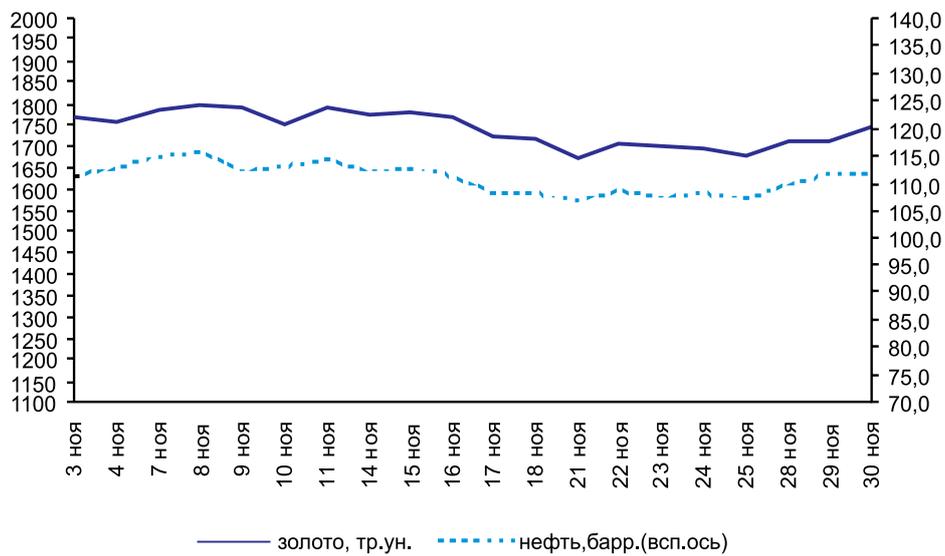
Курс	Значение		Изменение	
	18.11.2011	30.11.2011	за период	с дек.2001г.
USD/JPY	76,91	77,57	0,86%	-40,84%
GBP/USD	1,5806	1,5712	-0,59%	8,26%
EUR/USD	1,3525	1,3448	-0,57%	51,87%
USD/RUR	30,73	31,40	2,17%	2,97%

Курсы евро и японской йены по отношению к доллару США



Товары	Ед.измерения	Цена, долл. США		Изменение	
		18.11.2011	30.11.2011	за период	с дек.01г.
золото	тр.ун.	1718,9	1745,6	1,55%	530,97%
медь	метр.тонна	7 500,8	7 859,5	4,78%	438,16%
цинк	метр.тонна	1 956,8	2 073,3	5,95%	168,73%
нефть	баррель	107,91	111,32	3,16%	448,37%
зерно	тонна	219,27	218,71	-0,26%	116,85%

Цены на золото и нефть в долл. США



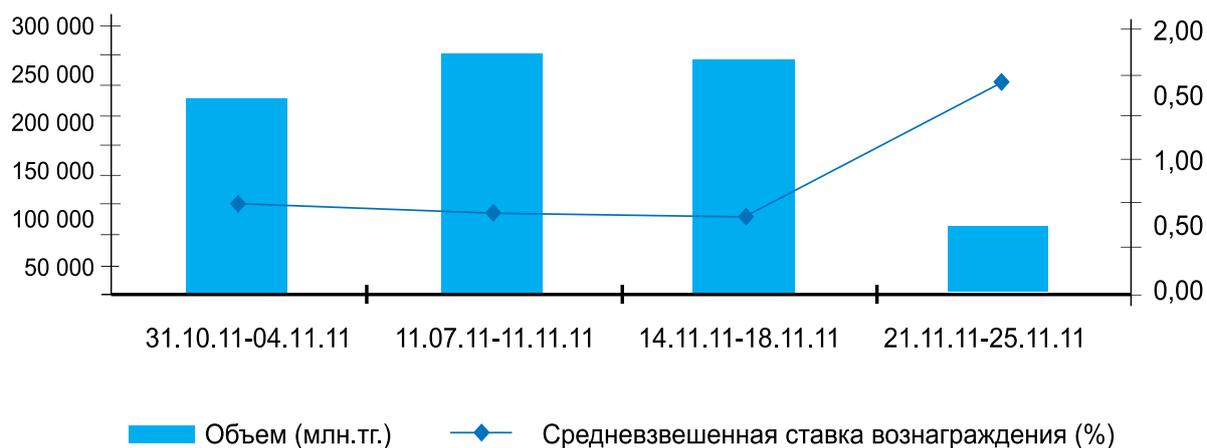
6. МЕЖБАНКОВСКИЙ ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Сведения по межбанковским краткосрочным депозитам банков второго уровня

	Банки-резиденты				Банки-нерезиденты			
	до 1 месяца		свыше 1 месяца		до 1 месяца		свыше 1 месяца	
	Объем размещенных депозитов*	Средневзвешенная ставка вознаграждения (%)	Объем размещенных депозитов*	Средневзвешенная ставка вознаграждения (%)	Объем размещенных депозитов*	Средневзвешенная ставка вознаграждения (%)	Объем размещенных депозитов*	Средневзвешенная ставка вознаграждения (%)
31.10.11-04.11.11								
KZT	206 500 000	0,63	1 800 000	1,00	7 110	3	0	0,00
USD	0	0,00	0	0,00	1 274 495	0,41	87	6,38
EURO	0	0,00	0	0,00	245 100	0,76	0	0,00
RUR	0	0,00	0	0,00	2 320 000	3,84	0	0,00
07.11.11-11.11.11								
KZT	258 300 000	0,57	1 400 000	2,38	1 000	3	0	0,00
USD	52 000	0,26	0	0,00	1 341 821	0,12	200	6,35
EURO	100	1,25	0	0,00	260 000	0,64	0	0,00
RUR	0	0,00	0	0,00	2 053 000	4,08	0	0,00
14.11.11-18.11.11								
KZT	246 700 000	0,54	5 500 000	1,00	101 000	1	0	0,00
USD	43 000	0,27	0	0,00	1 718 939	0,11	36 700	1,53
EURO	0	0,00	0	0,00	242 000	0,47	14 000	3,71
RUR	0	0,00	0	0,00	2 436 000	4,64	0	0,00
21.11.11-25.11.11								
KZT	67 220 000	1,51	1 500 000	1,60	121 000	3	0	0,00
USD	20 000	0,20	0	0,00	1 782 736	0,13	0	0,00
EURO	0	0,00	0	0,00	197 000	0,47	0	0,00
RUR	0	0,00	0	0,00	1 043 000	4,82	0	0,00

*-тыс. единиц валюты

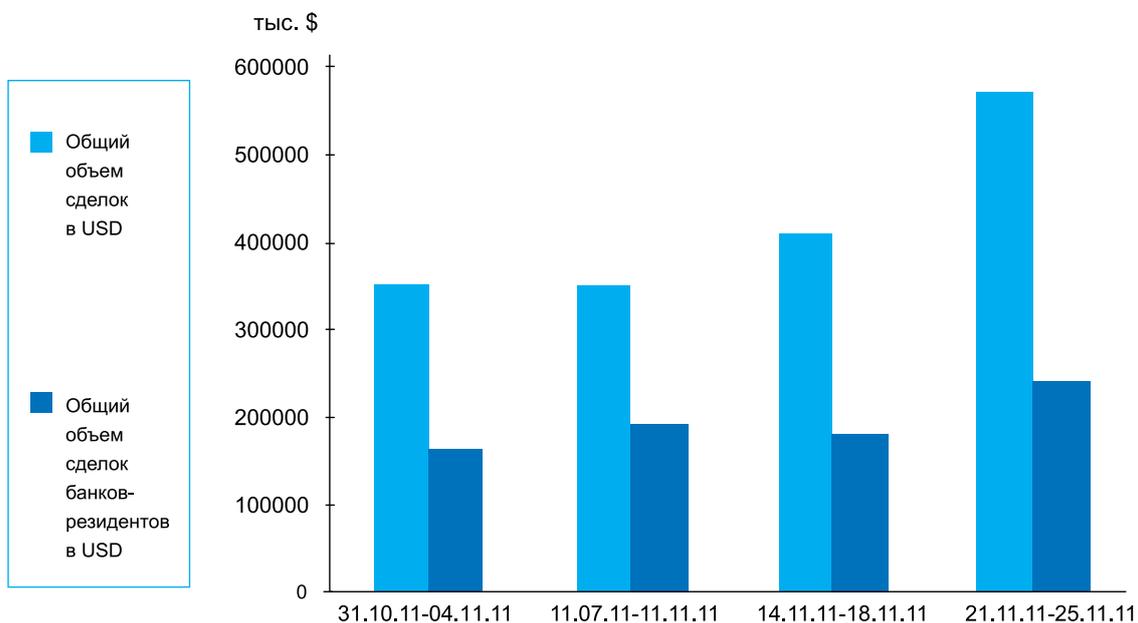
Тенговые депозиты и уровень доходности по ним на межбанковском денежном рынке



Внебиржевые межбанковские валютные операции (продажа)

Периоды, виды валют	Общий объем сделок (тыс.единиц валюты)	из них банков-резидентов		Средневзвешенный курс сделки, тенге за единицу валюты	из них: банков-резидентов
		(тыс.единиц валюты)	% *		
31.10.11-04.11.11					
USD	351 273	159 894	45,5	147,86	147,86
RUB	22 400	7 400	33,0	4,87	4,85
EUR	4 161	4 161	100,0	204,11	204,11
07.11.11-11.11.11					
USD	349 328	190 720	54,6	148,01	148,03
RUB	93 400	82 400	88,2	4,85	4,85
EUR	1 825	1 825	100,0	203,84	203,84
14.11.11-18.11.11					
USD	407 561	177 712	43,6	148,07	148,04
RUB	126 141	124 400	98,6	4,84	4,84
EUR	6 017	6 017	100,0	200,55	200,55
21.11.11-25.11.11					
USD	567 590	236 822	41,7	147,45	147,40
RUB	122 300	110 300	90,2	4,70	4,69
EUR	3 430	3 415	99,6	198,88	198,89

* удельный вес сделок банков-резидентов к общему объему сделок



ПОСТАНОВЛЕНИЕ ПРАВЛЕНИЯ НАЦИОНАЛЬНОГО БАНКА РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН

г. Алматы

30 сентября 2011 года

№117

О внесении дополнений и изменений в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 30 сентября 2005 года №358 «Об утверждении Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня»

В целях совершенствования нормативных правовых актов, регулирующих деятельность банков второго уровня, Правление Национального Банка Республики Казахстан постановляет:

1. В постановление Правления Агентства от 30 сентября 2005 года № 358 «Об утверждении Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3924) внести следующие дополнения и изменения:

в Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня, утвержденной указанным постановлением:

дополнить пунктом 3-1 следующего содержания:

«3-1. Инвестиции банка при расчете собственного капитала для целей пункта 3 статьи 8 Закона Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан» представляют собой вложения банка в субординированный долг юридического лица, совокупный размер которых превышает десять процентов суммы капитала первого уровня и капитала второго уровня банка.»;

пункт 4 изложить в следующей редакции:

«4. Капитал первого уровня рассчитывается как сумма:

оплаченного уставного капитала за минусом собственных выкупленных акций;

дополнительного капитала;

нераспределенного чистого дохода прошлых лет (в том числе фонды, резервы, сформированные за счет чистого дохода прошлых лет);

бессрочных договоров, в результате которых одновременно возникает финансовый актив у одного лица и финансовое обязательство или иной финансовый инструмент, подтверждающий право на долю активов юридического лица, оставшихся после вычетов всех его обязательств, у другого лица (далее - бессрочные финансовые инструменты, указанные в пунктах 5-9 настоящей Инструкции);

отложенного налогового обязательства, сформированного за счет нераспределенного чистого дохода прошлых лет, возникшего в связи с разницей в балансовой стоимости активов и обязательств, подлежащих классификации в соответствии с требованиями постановления Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 25 декабря 2006 года № 296 «Об утверждении Правил классификации активов, условных обязательств и создания провизий (резервов) против них» (зарегистрированного в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 4580) (далее – постановление № 296), и их налоговой базой;

за минусом:

нематериальных активов, за исключением лицензионного программного обеспечения, приобретенного для целей основной деятельности банка и соответствующего Международному стандарту финансовой отчетности 38 «Нематериальные активы», утвержденному Правлением Комитета по международным стандартам финансовой отчетности в июле 1998 года, вступившему в силу для финансовой отчетности, охватывающей периоды, начинающиеся с или после 1 июля 1999 года (далее - Международный стандарт финансовой отчетности 38);

убытков прошлых лет;

убытка текущего года.

Допускается включение банками, осуществляющими (осуществившими) реструктуризацию в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан», в капитал первого уровня доходов текущего года, полученных в финансовом году завершения реструктуризации.»;

в части первой пункта 10:

абзац второй изложить в следующей редакции:

«размера нераспределенной чистой прибыли.»;

абзац шестой изложить в следующей редакции:

«субординированного долга второго уровня банка, включаемого в собственный капитал, в сумме, не превышающей пятьдесят процентов суммы капитала первого уровня, за минусом выкупленного собственного субординированного долга банка.»;

дополнить абзацем седьмым следующего содержания:

«отложенного налогового обязательства, сформированного за счет расходов текущего года, возникшего в связи с разницей в балансовой стоимости активов и обязательств, подлежащих классификации в соответствии с требованиями постановления № 296, и их налоговой базой.»;

пункт 13 изложить в следующей редакции:

«13. Достаточность собственного капитала банка характеризуется тремя коэффициентами:

1) отношением капитала первого уровня за вычетом инвестиций банка, взятых в пределах доли капитала первого уровня в общей сумме капитала первого уровня и включаемой в расчет собственного капитала части капитала второго уровня, к размеру активов банка, уменьшенных на сумму инвестиций банка, взятых в пределах доли капитала первого уровня в общей сумме капитала первого уровня и включаемой в расчет собственного капитала части капитала второго уровня (k1-1);

2) отношением капитала первого уровня за вычетом инвестиций банка, взятых в пределах доли капитала первого уровня в общей сумме капитала первого уровня и включаемой в расчет собственного капитала части капитала второго уровня к сумме:

активов, условных и возможных обязательств, взвешенных по степени кредитного риска, уменьшенной на сумму общих резервов (провизий), не включенных в расчет капитала второго уровня;

активов, условных и возможных требований и обязательств, рассчитанных с учетом рыночного риска; операционного риска (k1-2);

3) отношением собственного капитала к сумме:

активов, условных и возможных обязательств, взвешенных по степени кредитного риска, уменьшенной на сумму общих резервов (провизий), не включенных в расчет капитала второго уровня;

активов, условных и возможных требований и обязательств, рассчитанных с учетом рыночного риска; операционного риска (k2).

Активы для целей расчета коэффициента k1-1 и активы, условные и возможные обязательства, взвешенные по степени риска, принимаемые в расчет коэффициентов k1-2 и k2, включаются по балансовой стоимости с учетом специальных резервов (провизий), сформированных в соответствии с требованиями постановления № 296.»;

пункт 16 изложить в следующей редакции:

«16. Значение коэффициента достаточности собственного капитала банка k2 составляет не менее 0,12.

Для банка, не имеющего крупного участника - физического лица, значение коэффициента достаточности собственного капитала банка k2 составляет не менее 0,14.

Для банка, участником которого является банковский холдинг либо родительский банк, для банка, более пятидесяти процентов размещенных акций которого принадлежат государству либо национальному управляющему холдингу, значение коэффициента достаточности собственного капитала банка k2 составляет не менее 0,10.

Расчет активов, условных и возможных обязательств, взвешиваемых по степени кредитного риска, проводится согласно приложениям 1 и 2 к настоящей Инструкции.

Для целей взвешивания активов, условных и возможных обязательств по степени риска активы, условные и возможные обязательства уменьшаются на сумму созданных специальных резервов (провизий), в соответствии с требованиями постановления № 296.

Условные и возможные обязательства, взвешиваемые по степени кредитного риска, определяются как произведение суммы условных и возможных обязательств, рассчитанных в соответствии с приложением 2 к настоящей Инструкции, на степень риска, соответствующую категории контрагента, указанной в приложении 1 к настоящей Инструкции, по которому банк несет кредитные риски.

Свопы, фьючерсы, опционы, форварды включаются в расчет условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, путем умножения суммы рыночной стоимости указанных финансовых инструментов и кредитного риска по ним на степень риска, соответствующую категории контрагента, указанной в приложении 1 к настоящей Инструкции.

Кредитный риск по операциям своп, фьючерс, опцион и форвард рассчитывается как произведение номинальной стоимости указанных финансовых инструментов на коэффициент кредитного риска, указанный в приложении 3 к настоящей Инструкции и определяемый сроком погашения указанных финансовых инструментов.

Рыночная стоимость (стоимость замещения) финансовых инструментов, указанная в настоящем пункте, представляет собой:

по сделкам на покупку - величину превышения текущей рыночной стоимости финансового инструмента над номинальной контрактной стоимостью данного финансового инструмента. В случае если текущая рыночная стоимость финансового инструмента меньше или равна ее номинальной контрактной стоимости, стоимость замещения равна нулю;

по сделкам на продажу - величину превышения номинальной контрактной стоимости финансового инструмента над текущей рыночной стоимостью данного финансового инструмента. В случае если номинальная контрактная стоимость финансового инструмента меньше или равна ее текущей рыночной стоимости, стоимость замещения равна нулю.

По бивалютным финансовым инструментам (финансовым инструментам, по которым требование и обязательство выражены в разных иностранных валютах) стоимость замещения определяется как величина превышения тенгового эквивалента требований над тенговым эквивалентом обязательств, определенных по курсу на дату составления отчетности. В случае если величина тенгового эквивалента требований меньше или равна тенговому эквиваленту обязательств, стоимость замещения равна нулю.

Номинальная контрактная стоимость финансовых инструментов, указанная в настоящем пункте, представляет собой стоимость финансовых инструментов, по которой они отражены на дату заключения сделок на соответствующих счетах бухгалтерского учета. За номинальную контрактную стоимость бивалютных финансовых инструментов принимается та валюта, по которой у банка формируются требования.

Проданные опционы не включаются в расчет условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска.

Расчет активов, условных и возможных требований и обязательств с учетом рыночного риска проводится согласно пунктам 17-30 настоящей Инструкции.

Расчет операционного риска проводится согласно пункту 31 настоящей Инструкции.

При расчете коэффициентов достаточности собственного капитала (k1-1, k1-2, k2) из размера активов и размера активов, подлежащих взвешиванию по степени риска вложений, исключаются неинвестированные остатки средств, принятых банком на хранение на основании кастодиального договора.»;

часть вторую пункта 31-11 изложить в следующей редакции:

«Вычет распределяется в размере пятидесяти процентов из капитала первого уровня и пятидесяти процентов из капитала второго уровня. Вычитаемые позиции уменьшаются на сумму, созданных специальных резервов (провизий), в соответствии с требованиями постановления № 296.»;

абзац первый подпункта 5) пункта 34 изложить в следующей редакции:

«5) за минусом суммы сформированных в соответствии с требованиями постановления № 296 специальных резервов (провизий), а также суммы обеспечения по обязательствам заемщика в виде:»;

часть первую пункта 44 изложить в следующей редакции:

«44. В расчет ликвидных активов включаются все финансовые активы, включая высоколиквидные активы, за минусом специальных сформированных провизий в соответствии с постановлением № 296, требований к нерезидентам Республики Казахстан, являющимся юридическими лицами, зарегистрированными на территории оффшорных зон, или их гражданами либо юридическими лицами, зарегистрированными на территории государств, отнесенных Организацией экономического сотрудничества и развития к перечню оффшорных территорий, не принявших обязательств по информационному обмену, или их гражданами, или к организациям, являющимся дочерними по отношению к юридическим лицам, зарегистрированным на территории указанных оффшорных зон. Займы включаются по графикам погашения в соответствии с договором займа.»;

часть седьмую пункта 47 изложить в следующей редакции:

«При расчете открытых валютных позиций по валютам отдельных иностранных государств (групп иностранных государств) (аффинированным драгоценным металлам) в первую очередь рассчитывается сальдо счетов по каждой иностранной валюте (аффинированному драгоценному металлу), открытых на счетах активов за вычетом, сформированных в соответствии с требованиями постановления № 296 специальных провизий, и на счетах обязательств банка. Затем определяется сальдо счетов по этой же иностранной валюте (аффинированному драгоценному металлу), открытых на счетах условных требований и на счетах условных обязательств за вычетом, сформированных в соответствии с требованиями постановления № 296 специальных провизий. Сальдо, отражающие превышение требований (обязательств) в иностранной валюте (аффинированном драгоценном металле) над обязательствами (требованиями), взаимно суммируются, а полученный результат определяет размер и вид открытой позиции банка по иностранной валюте (аффинированному драгоценному металлу).».

2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней со дня первого официального опубликования. Действие абзацев третьего и четвертого пункта 1 настоящего постановления распространяется на отношения, возникшие с 1 июля 2011 года.

* Зарегистрировано Министерством юстиции Республики Казахстан 16 ноября 2011 года под №7295

ПОСТАНОВЛЕНИЕ ПРАВЛЕНИЯ НАЦИОНАЛЬНОГО БАНКА РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН

г. Алматы

30 сентября 2011 года

№ 118

О внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан

В целях совершенствования порядка представления финансовой отчетности финансовыми организациями, Правление Национального Банка Республики Казахстан постановляет:

1. Внести изменения в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан, согласно приложению к настоящему постановлению.
2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования.

Зарегистрировано Министерством юстиции Республики Казахстан 28 ноября 2011 года под №7314
Согласовано с Агентством Республики Казахстан по статистике 26 октября 2011 года

Перечень изменений, которые вносятся в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан

Внести в нормативные правовые акты Республики Казахстан следующие изменения:

1. В постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее – Агентство) от 27 ноября 2004 года № 326 «Об утверждении Правил представления отчетности организацией, осуществляющей брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3313) следующие изменения:

в Правилах представления отчетности организацией, осуществляющей брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, утвержденных указанным постановлением:

пункт 1 изложить в следующей редакции:

«1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 4 июля 2003 года «О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций», Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года «О рынке ценных бумаг» и устанавливают перечень, формы, сроки и порядок представления отчетности организацией, осуществляющей брокерскую и дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг (далее - брокер и дилер), в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган).»;

в таблице «Отчет о ценных бумагах, приобретенных за счет собственных активов» приложения 1:

наименование изложить в следующей редакции:

«Отчет о ценных бумагах, приобретенных за счет собственных активов»;

графу 8 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, имеющиеся в наличии для продажи (за вычетом резервов на обесценение), в том числе: ».

графу 10 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости, изменения которых отражаются в составе прибыли или убытка, в том числе: ».

графу 12 в следующей редакции:

« Ценные бумаги, удерживаемые до погашения (за вычетом резервов на обесценение), в том числе: ».

2. В постановление Правления Агентства от 27 ноября 2004 года № 327 «Об утверждении Правил представления отчетности организацией, осуществляющей деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3343, опубликованное 28 октября 2005 года в газете «Юридическая газета» №199-200 (933-934)) следующие изменения:

в Правилах представления отчетности организацией, осуществляющей деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг, утвержденных указанным постановлением:

пункт 1 изложить в следующей редакции:

«1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 4 июля 2003 года «О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций», Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года «О рынке ценных бумаг» и определяют перечень, формы, сроки и порядок представления отчетности организацией, осуществляющей деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг (далее - регистратор), в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган).»;

в таблице «Отчет о ценных бумагах, приобретенных за счет собственных активов» приложения 1:

графу 8 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, имеющиеся в наличии для продажи (за вычетом резервов на обесценение), в том числе: »;

графу 10 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости, изменения которых отражаются в составе прибыли или убытка, в том числе ».

графу 12 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, удерживаемые до погашения (за вычетом резервов на обесценение), в том числе :».

3. В постановление Правления Агентства от 27 ноября 2004 года № 328 «Об утверждении Правил представления отчетности управляющим инвестиционным портфелем» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3314) следующие изменения:

в Правилах представления отчетности управляющим инвестиционным портфелем, утвержденных указанным постановлением: пункт 1 изложить в следующей редакции:

«1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 4 июля 2003 года «О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций», Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года «О рынке ценных бумаг» и определяют перечень, формы, сроки и порядок представления отчетности управляющим инвестиционным портфелем в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган).»;

в пункте 2:

подпункт 5) изложить в следующей редакции:

«5) сведения о доходности пая и о количестве пайщиков в соответствии с приложением 5 к настоящим Правилам (заполняется по каждому инвестиционному фонду);»;

подпункты 6) и 7) исключить;

в таблице «Отчет о ценных бумагах, приобретенных за счет собственных активов» приложения 1:

графу 8 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, имеющиеся в наличии для продажи (за вычетом резервов на обесценение), в том числе :»;

графу 10 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости, изменения которых отражаются в составе прибыли или убытка, в том числе:»;

графу 12 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, удерживаемые до погашения (за вычетом резервов на обесценение), в том числе :».

приложение 5 изложить в редакции, согласно приложению 1 к настоящему перечню.

4. В постановление Правления Агентства от 27 ноября 2004 года № 330 «Об утверждении Правил представления отчетности юридическими лицами, осуществляющими деятельность по инвестиционному управлению пенсионными активами» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3329, опубликованное в ноябре 2005 года в Бюллетене нормативных правовых актов центральных исполнительных и иных центральных государственных органов Республики Казахстан № 20, ст. 186) следующие изменения:

в Правилах представления отчетности юридическими лицами, осуществляющими деятельность по инвестиционному управлению пенсионными активами, утвержденных указанным постановлением:

преамбулу изложить в следующей редакции:

«Настоящие Правила разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 4 июля 2003 года «О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций», Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года «О рынке ценных бумаг» и определяют перечень, формы, сроки и порядок представления отчетности юридическими лицами, осуществляющими деятельность по инвестиционному управлению пенсионными активами (далее - Организация) в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган).»;

подпункт 7) пункта 1 изложить в следующей редакции:

«7) отчет об остатках собственных денежных средств и эквивалентов денежных средств по состоянию на конец каждого календарного дня отчетного периода в соответствии с приложением 7 к настоящим Правилам;»;

в таблице «Отчет о ценных бумагах, приобретенных за счет собственных активов» приложения 3:

графу 8 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, имеющиеся в наличии для продажи (за вычетом резервов на обесценение), в том числе: »;

графу 10 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, оцениваемые по справедливой стоимости, изменения которых отражаются в составе прибыли или убытка, в том числе: »;

графу 12 изложить в следующей редакции:

« Ценные бумаги, удерживаемые до погашения (за вычетом резервов на обесценение), в том числе: »;

приложение 7 изложить в редакции, согласно приложению 2 к настоящему перечню:

в таблице «Отчет о формировании резервов (провизий) на покрытие возможных потерь от обесценения ценных бумаг» приложения 8:

графу пятую строки, порядковый номер 4: изложить в следующей редакции:

«

25%
35%

 »;

графу пятую строки, порядковый номер 5: изложить в следующей редакции:

«

50%
70%

 »;

строку, порядковый номер 6 изложить в следующей редакции:

«	6.	Классификационная категория ценных бумаг «Безнадежная»	x		90%		»;
---	----	--	---	--	-----	--	----

дополнить строками, порядковые номера 6.1, 6.п, 7, 8, следующего содержания:

«	6.1.						
	6.п						
	7.	Всего	x		x		
	8.	Итого пенсионных активов	x		x		».

5. В постановление Правления Агентства от 17 июня 2006 года № 136 «Об утверждении Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 4301) следующие изменения:

в Правилах представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня, утвержденных указанным постановлением:

преамбулу изложить в следующей редакции:

«Настоящие Правила разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года «О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан», Законом Республики Казахстан от 4 июля 2003 года «О государственном регулировании и надзоре финансового рынка и финансовых организаций» и определяют порядок представления в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее – уполномоченный орган) банками второго уровня (далее – банки) отчетов о выполнении пруденциальных нормативов, обязательных к соблюдению банками.»;

часть первую пункта 2 изложить в следующей редакции:

«2. Отчет, указанный в приложении 1 к настоящим Правилам, представляется на бумажном носителе ежемесячно не позднее 18.00 часов времени города Астаны седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.»;

в таблице «Дополнительные сведения для расчета пруденциальных нормативов» приложения 23 строку, порядковый номер 8429, изложить в следующей редакции:

«	8429	Отрицательная разница между справедливыми стоимостями финансовых инструментов с учетом начисленной амортизации, выпущенных (приобретенных) в рамках реструктуризации		ежемесячно	».
---	------	--	--	------------	----

6. В постановление Правления Агентства от 26 сентября 2009 года № 215 «Об утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5810) следующие изменения:

пункт 2 изложить в следующей редакции:

«2. Настоящее постановление вводится в действие со дня его государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан, за исключением подпунктов 11), 12) пункта 11 Правил, которые вводятся в действие с 1 января 2010 года.

Действие абзаца четвертого подпункта 3) пункта 11 и абзаца четвертого подпункта 3) пункта 35 Правил распространяется до 1 января 2012 года.»;

в Правилах расчета пруденциальных нормативов для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, утвержденных указанным постановлением:

пункт 2 изложить в следующей редакции:

«2. Расчет и порядок представления отчетности по иным пруденциальным нормативам в Комитет по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций Национального Банка Республики Казахстан (далее - уполномоченный орган), не указанным в настоящих Правилах, для организаций, совмещающих виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, устанавливаются постановлениями Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 30 сентября 2005 года № 358 «Об утверждении Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 3924), от 17 июня 2006 года № 142 «Об утверждении Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов организациями, осуществляющими брокерскую и дилерскую деятельность с правом ведения счетов клиента в качестве номинального держателя и отдельные виды банковских операций» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 4300), от 28 апреля 2008 года № 56 «Об утверждении Правил расчета пруденциальных нормативов для организаций, осуществляющих брокерскую и дилерскую деятельность с правом ведения счетов клиента в качестве номинального держателя и отдельные виды банковских операций и внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5233), от 22 августа 2008 года № 121 «Об утверждении Правил расчета пруденциального норматива для организаций, осуществляющих деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 5325), определяющими порядок их расчета и представления отчетности.».

Приложение 1
к Перечню изменений, которые вносятся
в некоторые нормативные правовые акты
Республики Казахстан

«Приложение 5
к Правилам представления отчетности
управляющим инвестиционным портфелем

Сведения о доходности пая и о количестве пайщиков

(полное наименование управляющего инвестиционного портфелем)

(полное наименование инвестиционного фонда)

по состоянию на «__» _____ 20__ года

(в тысячах тенге)

	Примечание	На конец отчетного периода	На начало отчетного периода
Количество паев, находящихся в обращении			
Расчетная стоимость пая (для паевого инвестиционного фонда)			
Доходность пая (для паевого инвестиционного фонда), в % годовых $((P1/P2-1)/N \times 365 \text{ дней} \times 100)^*$			
Стоимость акций (для акционерного инвестиционного фонда)			
Количество пайщиков юридических лиц (для паевого инвестиционного фонда)			
Количество пайщиков физических лиц (для паевого инвестиционного фонда)			

* P1 - расчетная стоимость пая на конец отчетного периода;
P2 - расчетная стоимость пая на начало отчетного периода;
N - количество дней в квартале.

Первый руководитель (на период его отсутствия – лицо, его замещающее) _____
(фамилия, имя, при наличии - отчество) (подпись)

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

Исполнитель: _____
(должность, фамилия и имя) (подпись) (номер телефона)

Дата подписания отчета «__» _____ 20__ года.

Место для печати»;

Приложение 2
к Перечню изменений, которые вносятся в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан

«Приложение 7
к Правилам представления отчетности юридическими лицами, осуществляющими деятельность по инвестиционному управлению пенсионными активами

Отчет об остатках собственных денежных средств и эквивалентов денежных средств
за период с _____ по _____

(полное наименование организации,
осуществляющей инвестиционное управление пенсионными активами)

(в тысячах тенге)

1	Наименование 2	дата, месяц, год		дата, месяц, год	
		Сумма 4	в % к активам по балансу 5	Сумма	в % к активам по балансу
			
	Денежные средства и эквиваленты денежных средств, в том числе:						
1.	Наличные деньги в кассе						
2.	Деньги на счетах в банках и органи- зациях, осуществляющих отдельные виды банковских операций:						
1.1.							
1.n							
2	Сумма активов по балансу						

Первый руководитель (на период его отсутствия – лицо, его замещающее) _____
(фамилия, имя, при наличии - отчество) (подпись)

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

Исполнитель: _____
(должность, фамилия и имя) (подпись) (номер телефона)

Дата подписания отчета « ____ » _____ 20 ____ года.

Место для печати»;

ПОСТАНОВЛЕНИЕ ПРАВЛЕНИЯ НАЦИОНАЛЬНОГО БАНКА РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН

г. Алматы

30 сентября 2011 года

№ 121

Об утверждении Правил реализации приоритетного права государства на приобретение аффинированного золота в виде слитков для пополнения золотовалютных активов Национального Банка Республики Казахстан

В соответствии с Указом Президента Республики Казахстан от 21 июля 2011 года № 120 «О мерах по выполнению Решения Межгосударственного совета (высшего органа Таможенного союза) Евразийского экономического сообщества «О едином нетарифном регулировании Таможенного союза Республики Беларусь, Республики Казахстан и Российской Федерации» от 27 ноября 2009 года № 19» Правление Национального Банка Республики Казахстан постановляет:

1. Утвердить прилагаемые Правила реализации приоритетного права государства на приобретение аффинированного золота в виде слитков для пополнения золотовалютных активов Национального Банка Республики Казахстан.
2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования.

Зарегистрировано Министерством юстиции Республики Казахстан 21 ноября 2011 года под №7302

Правила реализации приоритетного права государства на приобретение аффинированного золота в виде слитков для пополнения золотовалютных активов Национального Банка Республики Казахстан

Глава 1. Общие положения

1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с Указом Президента Республики Казахстан от 21 июля 2011 года № 120 «О мерах по выполнению Решения Межгосударственного совета (высшего органа Таможенного союза) Евразийского экономического сообщества «О едином нетарифном регулировании Таможенного союза Республики Беларусь, Республики Казахстан и Российской Федерации» от 27 ноября 2009 года № 19» и Правилами ввоза на территорию Республики Казахстан из стран, не входящих в Таможенный союз, и вывоза с территории Республики Казахстан в эти страны драгоценных металлов и сырьевых товаров, содержащих драгоценные металлы, утвержденными постановлением Правительства Республики Казахстан от 16 августа 2011 года № 924 «Об утверждении Правил ввоза на территорию Республики Казахстан из стран, не входящих в Таможенный союз, и вывоза с территории Республики Казахстан в эти страны драгоценных металлов и сырьевых товаров, содержащих драгоценные металлы и о внесении дополнений в постановление Правительства Республики Казахстан от 26 ноября 2004 года № 1237 «Некоторые вопросы Министерства индустрии и новых технологий Республики Казахстан».

2. Настоящие Правила регулируют порядок принятия Национальным Банком Республики Казахстан (далее – Национальный Банк) решения о реализации приоритетного права государства на приобретение аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов (далее – приоритетное право).

Глава 2. Основные понятия, используемые в настоящих Правилах

3. В настоящих Правилах используются следующие понятия:

- 1) реализация приоритетного права – покупка Национальным Банком аффинированного золота в слитках напрямую у клиентов, обратившихся в Национальный Банк, а также отказ от его закупки;
- 2) бид-аск (bid-ask) спред – разница между ценой приобретения и продажи на международном рынке;
- 3) клиенты – субъекты, обратившиеся в Национальный Банк с предложением о реализации аффинированного золота в слитках;
- 4) хранилище – специально оборудованное помещение, где хранится аффинированное золото;
- 5) лимит приобретения – максимально возможный объем покупки Национальным Банком аффинированного золота в слитках за определенный период в рамках реализации приоритетного права;
- 6) торговый тикет (паспорт сделки) – подписываемый сторонами сделки документ, содержащий все существенные условия и параметры поставки конкретного лота аффинированного золота в слитках, согласно заключенному договору об общих условиях купли-продажи аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов;
- 7) аффинированное золото в слитках – драгоценный металл, прошедший стадию очистки и представленный в виде:
 - слитков производства государств-участников Таможенного союза, соответствующих установленным требованиям в государствах-участниках Таможенного союза либо международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов (London bullion market association) и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт «Лондонская качественная поставка» («London good delivery»);
 - слитков иностранного производства, изготовленных, клейменных и сертифицированных в соответствии с законодательством страны происхождения либо международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов (London bullion market association) и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт «Лондонская качественная поставка» («London good delivery»);
- 8) испытания аффинированного золота в слитках – комплекс работ, проводимых с целью установления количественных и качественных характеристик аффинированного золота в слитках.

Глава 3. Порядок реализации приоритетного права

4. Клиенты представляют в Национальный Банк графики прогноза производства и продажи аффинированного золота в слитках на первое полугодие будущего года – до 1 ноября текущего года, на второе полугодие текущего года – до 1 мая текущего года.

5. Председатель Национального Банка, основываясь на прогнозе производства и продажи аффинированного золота в слитках, состоянии денежного рынка, показателях денежно-кредитной политики и конъюнктуры международных финансовых рынков, утверждает лимит приобретения в рамках реализации приоритетного права на предстоящее полугодие либо принимает решение об отказе от реализации приоритетного права на предстоящий период (от месяца до полугодия).

В рамках утвержденного лимита приобретения Национальный Банк определяет объем аффинированного золота в слитках, который будет приобретен у конкретного клиента, предоставившего график прогноза и продаж аффинированного золота в слитках. Объемы приобретения доводятся до сведения клиентов на первое полугодие будущего года – до 1 декабря текущего года, на второе полугодие текущего года – до 1 июня текущего года.

В случае отказа от реализации приоритетного права на предстоящий период (от месяца до полугодия) решение об этом публикуется в течение пяти рабочих дней на официальном интернет-ресурсе Национального Банка.

6. Отказ от закупки аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов производится:

1) в случае достижения лимита приобретения аффинированного золота в слитках в рамках реализации приоритетного права;

2) в случае принятого решения об отказе от реализации приоритетного права на предстоящий период согласно пункту 5 настоящих Правил.

Отказ от закупки аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов не может быть произведен в отношении клиентов, указанных в части второй пункта 5 настоящих Правил, в пределах доведенных до них объемов приобретения аффинированного золота в слитках.

Подтверждение о готовности закупки либо отказ от закупки аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов доводится до клиента в течение 10 (десяти) рабочих дней со дня обращения клиента за подписью Председателя либо Заместителя Председателя Национального Банка.

7. Покупка аффинированного золота в слитках осуществляется на основе заключенного Национальным Банком с клиентом договора об общих условиях купли-продажи аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов, и торгового тикета (паспорта сделки), оформляемого на конкретный лот приобретаемого аффинированного золота в слитках.

Порядок проведения испытаний и предъявления претензий по качеству и количеству аффинированного золота в слитках устанавливается договором об общих условиях купли-продажи аффинированного золота в слитках для пополнения золотовалютных активов

8. Цена аффинированного золота в слитках определяется в тенге исходя из средневзвешенного биржевого курса тенге к доллару США на дату, предшествующую дате сделки, и среднего значения утреннего и вечернего фиксинга на золото Лондонской ассоциации рынка драгоценных металлов, усредненного на весь месяц поставки, и дисконта, включающего:

транспортные и таможенные расходы по экспорту золота на международные рынки;

расходы на стерилизацию избыточной денежной массы;

бид-аск (bid-ask) спред;

скидка за качество, которая применяется в случае приобретения слитков, не отвечающих международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт «Лондонская качественная поставка» («London good delivery»).

Ко всем слиткам одного качества, приобретаемому в одном периоде, применяется единая ставка дисконта.

ПОСТАНОВЛЕНИЕ ПРАВЛЕНИЯ НАЦИОНАЛЬНОГО БАНКА РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН

г. Алматы

30 сентября 2011 года

№ 122

О внесении изменений в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 июля 2006 года № 65 «Об утверждении Правил осуществления инвестиционных операций Национального фонда Республики Казахстан»

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 30 марта 1995 года «О Национальном Банке Республики Казахстан» и в целях повышения эффективности доверительного управления активами Национального фонда Республики Казахстан Правление Национального Банка Республики Казахстан постановляет:

1. В постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 25 июля 2006 года № 65 «Об утверждении Правил осуществления инвестиционных операций Национального фонда Республики Казахстан» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 4361) внести следующие изменения:

в Правилах осуществления инвестиционных операций Национального фонда Республики Казахстан, утвержденных указанным постановлением:

пункты 11 и 12 изложить в следующей редакции:

«11. MSCI World Index (MXWO) - индекс, состоящий из акций компаний развитых стран мира, составляемый компанией Morgan Stanley Capital International. Показатель доходности рассчитывается ежедневно.

12. Композитный Индекс облигаций - индекс индексов ценных бумаг с фиксированным доходом развитых стран мира, состоящий из высоколиквидных ценных бумаг:

Merrill Lynch U.S. Treasuries, 1-5 Yrs (GVQ0) - 30 (тридцать) процентов;

Merrill Lynch EMU Direct Governments, AAA-AA Rated, 1-5 Yrs (EG6V) - 35 (тридцать пять) процентов;

Merrill Lynch U.K. Gilts, 1-5 Yrs (GVL0) - 10 (десять) процентов;

Merrill Lynch Japanese Governments, 1-5 Yrs (GVY0) - 10 (десять) процентов;

Merrill Lynch Australian Government, 1-5 Yrs (GVT0) - 5 (пять) процентов;

Merrill Lynch Canadian Governments, 1-5 Yrs (GVC0) - 5 (пять) процентов;

Merrill Lynch South Korean Government Index, 1-5 Yrs (GSKV) - 5 (пять) процентов.

Возврат к эталонному распределению в данном индексе производится в последний рабочий день календарного квартала. Состав ценных бумаг в индексе меняется ежемесячно на основе рыночной капитализации. Показатели доходности и риска рассчитываются ежедневно.»;

подпункт 2) части первой пункта 46 изложить в следующей редакции:

«2) 20 (двадцать) процентов из индекса MSCI World Index.»;

пункт 62 изложить в следующей редакции:

«62. Рыночная стоимость активов Фонда, передаваемых одному кастодиану, не должна превышать эквивалент 25 (двадцати пяти) миллиардов долларов США.».

2. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней со дня его первого официального опубликования и распространяется на отношения, возникшие с 1 ноября 2011 года.

Зарегистрировано Министерством юстиции Республики Казахстан 21 ноября 2011 года под №7304

