

**Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 июля 2012 года № 228 Об установлении перечня финансовых инструментов, разрешенных к приобретению только за счет средств квалифицированных инвесторов**

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года «О рынке ценных бумаг» Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ**:

1. Установить следующий перечень финансовых инструментов, разрешенных к приобретению только за счет средств квалифицированных инвесторов:

1) ценные бумаги и (или) иные финансовые инструменты организаций - нерезидентов Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством иностранного государства и не включенные в списки ценных бумаг, обращаемых на фондовой бирже, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан либо иностранного государства;

2) акции и (или) паи инвестиционных фондов рискованного инвестирования;

3) производные ценные бумаги и (или) иные производные финансовые инструменты, не обращающиеся на фондовых и (или) товарных биржах, осуществляющих деятельность на территории Республики Казахстан либо иностранного государства.

2. Требование подпункта 3) пункта 1 настоящего постановления не распространяется:

1) на сделки с производными финансовыми инструментами, базовые активы которых определены в приложении 1 к настоящему постановлению, совершаемые на неорганизованном рынке при соблюдении одного из следующих условий:

контрпартнером - нерезидентом Республики Казахстан является организация, имеющая рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service и Fitch, либо контрпартнером - резидентом Республики Казахстан является организация, имеющая рейтинг по международной шкале не ниже «BB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «Ba3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service, либо рейтинговую оценку не ниже «kzBBB» по национальной шкале вышеуказанных рейтинговых агентств;

имеются котировки на покупку и (или) продажу в информационных аналитических системах Bloomberg или Reuters, либо в случае отсутствия таких котировок имеется не менее трех котировок от трех различных контрпартнеров, имеющих рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service и Fitch;

базовый актив производных финансовых инструментов допущен к обращению на организованном рынке ценных бумаг Республики Казахстан и (или) в системе организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами, указанными в приложении 2 к настоящему постановлению;

при предоставлении аудиторской организацией, осуществляющей аудит профессионального участника рынка ценных бумаг, отчета, предусматривающего выражение положительного мнения аудиторской организации:

о методиках оценки профессионального участника рынка ценных бумаг производного финансового инструмента;

о допущениях, использованных при определении стоимости производного финансового инструмента, включая информацию о допущениях, сделанных в отношении оценки кредитных потерь, процентных ставок или ставок дисконтирования;

о результатах стресс-тестирования, анализа чувствительности, проведенного профессиональным участником рынка ценных бумаг;

2) на инвестиции инвестиционного фонда, не являющегося фондом рискованного инвестирования, в производные ценные бумаги и (или) иные производные финансовые инструменты, не обращающиеся на фондовых и (или) товарных биржах, осуществляющих деятельность на территории Республики Казахстан либо иностранного государства.

3. Признать утратившим силу постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 79 «Об установлении перечня финансовых инструментов, разрешенных к приобретению только за счет средств квалифицированных инвесторов» (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 7471, опубликованное 24 мая 2012 года в газете «Казахстанская правда» № 150-151 (26969-26970)).

4. Настоящее постановление вводится в действие с 1 августа 2012 года и подлежит официальному опубликованию.

**Председатель  
Национального Банка**

**Г. Марченко**

Приложение 1  
к постановлению Правления  
Национального Банка  
Республики Казахстан  
от 27 июля 2012 года № 228

### **Базовые активы производных финансовых инструментов**

1) кредитный риск организаций:

резидентов Республики Казахстан, имеющих рейтинг по международной шкале не ниже «BB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «Ba3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service, либо рейтинговую оценку не ниже «kzBBB» по национальной шкале вышеуказанных рейтинговых агентств;

нерезидентов Республики Казахстан, имеющих рейтинг по международной шкале не ниже «BBB-» по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и Fitch или не ниже «BBa3» по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service;

организаций - резидентов Республики Казахстан по выданным им займам, а также заявителей - резидентов Республики Казахстан по выпущенным гарантиям и аккредитивам;

2) базовые активы, определенные пунктом 1 постановления Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 16 июля 2007 года № 210 «Об установлении перечня и порядка приобретения базовых активов производных ценных бумаг и производных финансовых инструментов, с которыми банки второго уровня могут осуществлять брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, а также случаев заключения сделок с государственными ценными бумагами и негосударственными ценными бумагами на вторичном рынке, производными финансовыми инструментами на неорганизованном рынке ценных бумаг» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов № 4892).

Приложение 2  
к постановлению Правления  
Национального Банка  
Республики Казахстан  
от 27 июля 2012 года № 228

### **Список организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами**

1. Фондовая биржа Австралии (Australian Stock Exchange)
2. Австрийская фондовая биржа (Wiener bourse AG)
3. Американская фондовая биржа (American Stock Exchange)
4. Европейская фондовая биржа «Евронекст» в Амстердаме (Euronext Amsterdam)
5. Фондовая биржа Афин (Athens Exchange)
6. Европейская фондовая биржа «Евронекст» в Брюсселе (Euronext Brussels)
7. Гонконгская фондовая биржа (Hong Kong Exchanges and Clearing)
8. Фондовая биржа Джакарты (Jakarta Stock Exchange)

9. Фондовая биржа Новой Зеландии (New Zealand Exchange)
10. Ирландская фондовая биржа (Irish Stock Exchange)
11. Объединенная фондовая биржа Испании (BME Spanish Exchanges)
12. Итальянская фондовая биржа (Borsa Italiana SPA)
13. Фондовая биржа Йоханнесбурга (Южная Африка) (JSE Securities Exchange South Africa)
14. Фондовая биржа Копенгагена (Copenhagen Stock Exchange)
15. Объединенная фондовая биржа, в состав которой входят биржи Стокгольма, Хельсинки, Таллина и Риги (Hex Integrated Markets Ltd.)
16. Европейская фондовая биржа «Евронекст» в Лиссабоне (Euronext Lisbon)
17. Лондонская фондовая биржа (London Stock Exchange)
18. Лондонская международная биржа финансовых фьючерсов (London International Financial Futures and Options Exchange)
19. Фондовая биржа Люксембурга (Bourse de Luxembourg)
20. Малайзийская фондовая биржа (Bursa Malaysia)
21. Фондовая биржа Мальты (Malta Stock Exchange)
22. Фондовая биржа Монреаля (Bourse de Montreal)
23. Немецкая фондовая биржа (Deutsche bourse AG)
24. Нью-Йоркская фондовая биржа (New York Stock Exchange)
25. Южнокорейская фондовая биржа (Korea Stock Exchange)
26. Фондовая биржа Осаки (Osaka Securities Exchange)
27. Фондовая биржа Осло (Oslo bourse)
28. Европейская фондовая биржа «Евронекст» в Париже (Euronext Paris)
29. Сингапурская фондовая биржа (Singapore Exchange)
30. Стамбульская фондовая биржа (Istanbul Stock Exchange)
31. Стокгольмская фондовая биржа (Stockholm Exchange)
32. Токийская фондовая биржа (Tokyo Stock Exchange)
33. Национальная фондовая биржа Индии (National Stock Exchange of India Limited)
34. Филиппинская фондовая биржа (Philippine Stock Exchange)
35. Франкфуртская фондовая биржа (Frankfurt Stock Exchange)
36. Французская международная биржа финансовых фьючерсов (French International Financial Futures Exchange MATIF)
37. Чикагская срочная товарная биржа (The Chicago Board of Trade)
38. Чикагская биржа опционов (Chicago Board Options Exchange)
39. Чикагская товарная биржа (Chicago Mercantile Exchange)
40. Шанхайская фондовая биржа (Shanghai Stock Exchange)
41. Фондовая биржа Швейцарии (SWX Swiss Exchange)
42. Шэньчженьская фондовая биржа (Shenchzhen Stock Exchange)