|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **«ҚАЗАҚСТАН РЕСПУБЛИКАСЫНЫҢ****ҰЛТТЫҚ БАНКІ»**РЕСПУБЛИКАЛЫҚ МЕМЛЕКЕТТІК МЕКЕМЕСІ |  | РЕСПУБЛИКАНСКОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ**«НАЦИОНАЛЬНЫЙ БАНК****РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН»** |
| **БАСҚАРМАСЫНЫҢ****ҚАУЛЫСЫ** |  | **ПОСТАНОВЛЕНИЕ** **ПРАВЛЕНИЯ** |
| 2019 жылғы «19» қараша Алматы қаласы |  | № 197город Алматы |

## Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы

## құралдарымен операциялар жүргізуі

**тәртібін бекіту туралы**

«Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі туралы» 1995 жылғы 30 наурыздағы Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізу тәртібін айқындау мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:

1. Қоса беріліп отырған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі тәртібі бекітілсін.

2. Монетарлық операциялар департаменті:

1) осы қаулыны Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі орталық аппаратының мүдделі бөлімшелеріне жіберсін;

2) осы қаулыны Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ресми интернет-ресурсына орналастырсын.

3. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары Е.А. Біртановқа жүктелсін.

4. Осы қаулы 2020 жылғы 1 қаңтардан бастап күшіне енеді.

**Ұлттық Банк**

 **Төрағасы Е. Досаев**

Қазақстан Республикасы

Ұлттық Банкі Басқармасының

2019 жылғы «19» қарашадағы

№ 197 қаулысымен

бекітілді

**Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі тәртібі**

**1-тарау. Жалпы ережелер**

1. Осы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі тәртібі (бұдан әрі – Тәртіп) 1994 жылғы 27 желтоқсандағы Қазақстан Республикасының Азаматтық кодексіне
(бұдан әрі – Азаматтық кодекс), «Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі туралы» 1995 жылғы 30 наурыздағы (бұдан әрі – Ұлттық Банк туралы заң), «Бағалы қағаздар рыногы туралы» 2003 жылғы 2 шілдедегі (бұдан әрі – Бағалы қағаздар нарығы туралы заң) Қазақстан Республикасының Заңдарына сәйкес әзірленді және Қазақстан Республикасының қаржы жүйесінің тұрақтылығын қамтамасыз етуге, Қазақстан Республикасының мемлекеттік ақша-кредит саясатын (бұдан әрі – ақша-кредит саясаты) жүргізуге, нарық коньюнктурасының өзгеруінен болатын әлеуетті шығындар тәуекелін барынша азайтуға бағытталған шараларды жүзеге асыру үшін және Қазақстан Республикасы Ұлттық Банктің алтынвалюта активтері (бұдан әрі – алтынвалюта активтері) мен Ұлттық қордың активтері (бұдан әрі – Ұлттық қордың активтері) портфельдерінің кірістілігін арттыру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – Ұлттық Банк) туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізу тәртібін айқындайды.

2. Тәртіпте Азаматтық кодексте көзделген, сондай-ақ мына ұғымдар пайдаланылады:

1) алтын-валюта активтер портфелі – Ұлттық Банк туралы заңға сәйкес алтын-валюта резервтерінен және өзге активтерден тұратын портфель;

2) биржа нарығы – қаржы құралдарымен сауда-саттықтарды тікелей өткізу арқылы ұйымдастырушылық және техникалық қамтамасыз етуді жүзеге асыратын сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда жүйелерін пайдалана отырып жүргізілетін қатынастар жиынтығы;

3) биржадан тыс нарық – сауда-саттықты ұйымдастырушылардың сауда жүйелерін пайдаланусыз шетел валютасын, бағалы қағаздарды және (немесе) өзге де қаржы құралдарын сатып алу және (немесе) сату бойынша операцияларды жүзеге асыру кезінде туындайтын нарықтың кәсіби қатысушылары қатынастарының жиынтығы;

4) дилер – сауда бөлімшесі фронт-офисінің қызметкері;

5)  жинақтау портфелі – мақсаты ұзақмерзімді перспективада активтердің кірістілігін арттыру болып табылатын Ұлттық қор активтерінің портфелі;

6) клирингтік қатысушы – клиринг ұйымымен клирингтік қызмет көрсету туралы шартты жасасқан заңды тұлға;

7) контрәріптес – Ұлттық Банк тиісті шарттардың (келісімдердің) негізінде туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізетін (мәмілелер жасайтын) заңды тұлға;

8) мәміле паспорты – онда көрсетілген шарттарға сәйкес қаржы құралымен мәміле жасасуды куәландыратын құжат;

9) мидл-офис – сауда бөлімшесінің қаржы нарықтарын және алтынвалюта активтерінің және Ұлттық қор активтерінің портфельдерін талдауға уәкілетті бөлімшесі;

10) портфель – қаржы құралдарының жиынтығы, оның ішінде қолма-қол валюта;

11) сауда бөлімшесі – Ұлттық Банктің ақша-кредит сасатын іске асыру және алтынвалюта активтерін басқару үшін жауапты монетарлық операциялар бөлімшесі;

12) туынды қаржы құралдары – форвард, своп, форвардтық пайыздық мөлшерлеме туралы келісім (ФРА), опцион, фьючерс және олардың комбинациясын білдіретін басқа да туынды қаржы құралдары;

13) тұрақтандыру портфелі – мақсаты активтердің өтімділігін арттыру және қысқамерзімді перспективада кірістілікті ұлғайту болып табылатын Ұлттық қор активтерінің портфелі;

14) Ұлттық қор активтерінің портфелі – жинақтау және тұрақтандыру портфельдерінен тұратын портфель;

15) фронт-офис – сауда бөлімшесінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуге уәкілетті басқармасы;

 16) «Thomson Reuters FX Trading», «Bloomberg» жүйелері – туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасау мақсаттары үшін оларды пайдаланушылар арасында байланыс жүзеге асырылатын арнайы бағдарламалық қамтамасыз ету мен жабдықтар кешендері;

17) «Thomson Reuters Eikon», «Bloomberg», «Barra» жүйелері – туынды қаржы құралдары олар арқылы бағаланатын арнайы бағдарламалық қамтамасыз ету мен жабдықтар кешендері.

3. Ұлттық Банк своп операцияларын валюталық, пайыздық және кредиттік тәуекелдерді төмендету, форвард мәмілелерін жүргізу кезінде базалық активтегі өтімділікті қолдау, олар бойынша ашық позицияларды ұзарту үшін, сондай-ақ ақша-кредит саясатын іске асыру, Қазақстан Республикасының қаржы жүйесінің тұрақтылығын қамтамасыз ету және алтынвалюта активтері мен Ұлттық қор активтері портфельдерінің кірістілігін арттыру мақсатында жүргізеді.

Ұлттық Банк форвард және опцион операцияларын нарықтағы бағаның жағымсыз өзгеруі салдарынан ықтимал шығындардан хеджирлеу мақсатында, сондай-ақ бағалы қағаздардағы, индекстердегі, валютадағы, алтындағы және нарықтық құны бар басқа да активтердегі кірістілікті арттыру мақсатында жүргізеді.

Ұлттық Банк пайыздық своп және форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операцияларды пайыздық мөлшерлемелердің теріс өзгеруінен хеджирлеу және салымдарды (депозиттерді) орналастырумен байланысты кредиттік тәуекелді барынша азайта отырып, ұзақмерзімді кезеңде неғұрлым жоғары кірістілік алу мақсатында жүргізеді. Ұлттық Банк пайыздық своп операцияларын бағалы қағаздардағы, валютадағы, алтындағы және нарықтық құны бар басқа да активтердегі кірістілікті арттыру мақсатында, не ақша-кредит саясатын іске асыру және Қазақстан Республикасының қаржы жүйесінің тұрақтылығын қамтамасыз ету шеңберінде де жүргізеді.

Ұлттық Банк фьючерс операцияларын алтынвалюта активтері мен Ұлттық қордың активтері портфельдерін пайыздық тәуекелден хеджирлеу, сондай-ақ бағалы қағаздардағы, индекстердегі, валютадағы, алтындағы және нарықтық құны бар басқа да активтердегі кірістілікті арттыру мақсатында жүргізеді.

Ұлттық Банк свопцион операцияларын пайыздық своптар бойынша ашық позицияларды хеджирлеу және бағалы қағаздардағы, индекстердегі, валютадағы, алтындағы және нарықтық құны бар басқа да активтердегі кірістілікті арттыру мақсатында жүргізеді.

4. Ұлттық Банк туынды қаржы құралдарымен операцияларды ұлттық валютада да, шетел валютасында да жүргізеді.

5. Мидл-офис Ұлттық Банк сатып алған туынды қаржы құралдарын бағалауды «Thomson Reuters Eikon», «Bloomberg», «Barra» жүйелерінің, сондай-ақ кастодиандар мен контрәріптестердің деректері негізінде жүргізеді.

6. Ұлттық Банк биржадан тыс нарықта туынды қаржы құралдарымен мәмілелерді телефон байланысы, «Thomson Reuters FX Trading», «Bloomberg» жүйелері арқылы, биржа нарығында биржалық сауда жүйесі немесе контрәріптес банк сауда жүйесі арқылы жасайды.

7. Ұлттық Банк Қазақстан Республикасы Үкіметінің қаулысымен бекітілген Ұлттық қорды орналастыру үшін материалдық емес активтерді қоспағанда, рұқсат етілген қаржы құралдарының тізбесіне сәйкес Ұлттық қор активтерінің портфелі үшін туынды қаржы құралдарымен операцияларды жүзеге асырады.

**2-тарау. Биржадан тыс нарықта туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізу**

8. Ұлттық Банк биржадан тыс нарықта туынды қаржы құралдарымен операцияларды мәміле паспорттары, мәміле жасасу туралы келісімдердің және (немесе) қаржы құралдарымен мәмілелер жасасуға қосылу туралы шарттың негізінде жүргізеді.

9. Биржадан тыс нарықта туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу үшін дилер контрәріптестерден баға белгілеулерді сұратады немесе мәміленің қажетті талаптарын (мәміле типін (сатып алу/сату), мәміле валютасын, пайыздық мөлшерлемені, мәміле бойынша валюталау кезеңін, күнін, мәмілені аяқтау күнін және өзге талаптарды) көрсете отырып, мәмілені орындауға өтінім береді.

10. Фронт-офис контрәріптестерден келіп түскен ұсыныстарды және баға белгілеулерді салыстырып талдайды, деректердің (пайыздық мөлшерлемелердің, валюта бағамдарының, индекстердің және нарықтық құны бар басқа да активтердің) болжамдық мәндерін айқындайды, биржадан тыс туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізеді.

11. Биржадан тыс нарықта туынды қаржы құралдарымен операциялар бойынша мәміле жасалғаннан кейін дилер мәміленің өлшемдері көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды, мәміленің өлшемдерін Ұлттық Банктің ақпараттық жүйесіне енгізеді және мәміле паспортын Ұлттық Банктің операциялық есепке алу бөлімшесіне ұсынады.

**3-тарау.** **Биржа нарығында туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізу**

12. Ұлттық Банк биржа нарығында туынды қаржы құралдарымен операцияларды мәміле паспорттары, мәміле жасасу туралы келісімдердің және (немесе) қаржы құралдарымен мәмілелер жасасуға қосылу туралы шарттың негізінде жүргізеді.

13. Ұлттық Банк клирингтік қатысушымен жасалған келісімнің негізінде биржа нарығында туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізеді.

14. Биржа нарығында туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу үшін дилер мәміле талаптарын (туынды қаржы құралының түрін, мәміле типін (сатып алу/сату), валютаны, мәмілелер санын, мәміле сомасын, сатып алу/сату бағасын, мәмілені валюталау күнін, өтеу күнін және өзге талаптарды) көрсете отырып, мәмілені орындауға өтінім береді.

15. Биржа нарығында туынды қаржы құралдарымен операциялар бойынша мәміле жасалғаннан кейін дилер сауда-саттықты ұйымдастырушының ішкі құжаттарына сәйкес мәміле өлшемдері көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды, мәміленің өлшемдерін Ұлттық Банктің ақпараттық жүйесіне енгізеді және мәміле паспортын Ұлттық Банктің операциялық есепке алу бөлімшесіне ұсынады.