

АО "ЦЕНТРАЛЬНЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ ЦЕННЫХ БУМАГ"

ОТЧЕТ

о соблюдении АО "Центральный депозитарий ценных бумаг" принципов для инфраструктур финансового рынка

г. Алматы

2021

Предоставляющее информацию учреждение:

АО "Центральный депозитарий ценных бумаг"

Юрисдикции, в которых функционирует ИФР:

Республика Казахстан

Компетентные органы, осуществляющие регулирование, надзор и наблюдение за ИФР:

Национальный Банк Республики Казахстан

Агентство Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка

Дата раскрытия информации:

январь 2022 года

Данную информацию также можно найти на интернет-сайте:

www.kacd.kz

Контактное лицо для получения дополнительной информации:

Алия Джумакова

+7 (727) 355 47 60, внутр. 360, jumakovaa@kacd.kz

Шакир Иминов

+7 (727) 262 08 46, внутр. 397, IminovSh@kacd.kz

ОГЛАВЛЕНИЕ

<u>4</u>	Глоссарий
<u>5</u>	I. Пояснительная записка
<u>6</u>	II. Краткий обзор основных изменений с момента последнего обновления раскрываемой информации
<u>9</u>	III. Справочная информация об ИФР
<u>20</u>	IV. Краткое изложение раскрываемой информации по принципам
<u>20</u>	Принцип 1. Правовая основа
<u>22</u>	Принцип 2. Управление
<u>25</u>	Принцип 3. Система комплексного управления рисками
<u>27</u>	Принцип 4. Кредитный риск
<u>32</u>	Принцип 5. Залоговое обеспечение
<u>33</u>	Принцип 6. Гарантийный депозит
<u>37</u>	Принцип 7. Риск ликвидности
<u>44</u>	Принцип 8. Завершенность расчетов
<u>45</u>	Принцип 9. Денежные расчеты
<u>47</u>	Принцип 10. Фактическая поставка
<u>48</u>	Принцип 11. Центральные депозитарии ценных бумаг
<u>50</u>	Принцип 12. Расчетные системы обмена активами
<u>51</u>	Принцип 13. Правила и процедуры, относящиеся к невыполнению обязательств участником
<u>52</u>	Принцип 14. Сегрегация и перемещаемость
<u>54</u>	Принцип 15. Общий коммерческий риск
<u>56</u>	Принцип 16. Депозитарный и инвестиционный риски
<u>58</u>	Принцип 17. Операционный риск
<u>61</u>	Принцип 18. Требования к доступу и участию
<u>62</u>	Принцип 19. Многоуровневая структура участия
<u>63</u>	Принцип 20. Связи ИФР
<u>67</u>	Принцип 21. Эффективность и результативность
<u>69</u>	Принцип 22. Процедуры и стандарты передачи сообщений
<u>69</u>	Принцип 23. Раскрытие правил, основных процедур и рыночных данных
<u>71</u>	Принцип 24. Раскрытие рыночных данных торговыми репозиториями
<u>73</u>	V. Перечень общедоступных источников

ГЛОССАРИЙ

АРМ	автоматизированное рабочее место
АРРФР	Агентство Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка
КАСЕ	АО "Казахстанская фондовая биржа"
интернет-сайт Центрального депозитария	интернет-сайт Центрального депозитария с доменным именем www.kacd.kz
информирующее лицо	лицо, обязанное во исполнение требований законодательства Республики Казахстан предоставлять Центральному депозитарию информацию о сделках, заключенных данным лицом, для ее включения в реестр сделок
ИФР	инфраструктура финансового рынка
КЦМР	Республиканское государственное предприятие на праве хозяйственного ведения "Казахстанский центр межбанковских расчетов Национального Банка Республики Казахстан"
млн	миллион
млрд	миллиард
МСПД	межбанковская система переводов денег, оперируемая Республиканским государственным предприятием на праве хозяйственного ведения "Казахстанский центр межбанковских расчетов Национального Банка Республики Казахстан"
Национальный Банк	Национальный Банк Республики Казахстан
Правление	Правление Центрального депозитария
Свод правил	свод правил Центрального депозитария
Совет директоров	Совет директоров Центрального депозитария
СРЦБ	система расчетов по ценным бумагам
ТР	торговый репозиторий
уполномоченный орган	государственный орган по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций
ЦДЦБ	Центральный депозитарий ценных бумаг
Центральный депозитарий	АО "Центральный депозитарий ценных бумаг"
ЦКА	центральный контрагент

I. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

Настоящее раскрытие информации о соблюдении принципов для инфраструктур финансового рынка составлено в соответствии с докладом Комитета по платежным и расчетным системам и Международной организации комиссий по ценным бумагам "Структура раскрытия информации и методология оценки" (декабрь 2012 года).

Центральный депозитарий является единственной организацией на территории Республики Казахстан, осуществляющей депозитарную деятельность.

Клиентами Центрального депозитария являются:

- 1) организации, осуществляющие брокерскую деятельность на рынке ценных бумаг с правом ведения счетов номинального держания на основании лицензии уполномоченного органа или в соответствии с законодательством Республики Казахстан;
- 2) организации, осуществляющие брокерскую деятельность на рынке ценных бумаг без права ведения счетов номинального держания на основании лицензии уполномоченного органа или в соответствии с законодательством Республики Казахстан;
- 3) организации, осуществляющие дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг на основании лицензии уполномоченного органа или в соответствии с законодательством Республики Казахстан;
- 4) депоненты, являющиеся иностранными депозитариями, кастодианами и (или) номинальными держателями финансовых инструментов;
- 5) организации, осуществляющие клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами и (или) деятельность ЦКА;
- 6) иностранные дилеры и (или) иные юридические лица, являющиеся членами фондовой биржи и (или) клиринговыми участниками клиринговой организации;
- 7) организация, осуществляющая регистрацию сделок с ценными бумагами на территории Международного финансового центра "Астана";
- 8) клиенты депонентов, за исключением тех лиц, которым открыты субсчета в системе учета Центрального депозитария на основании сведений, представленных депонентом без раскрытия отдельных реквизитов данных лиц в соответствии с условиями договора о номинальном держании и Сводом правил;
- 9) иные физические и юридические лица, прошедшие процедуру установления деловых отношений.

Центральный депозитарий имеет адекватную систему управления рисками и обеспечения непрерывности деятельности.

Условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности на рынке ценных бумаг устанавливаются законом Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг", нормативными правовыми актами уполномоченного органа и внутренними документами – Сводом правил.

II. КРАТКИЙ ОБЗОР ОСНОВНЫХ ИЗМЕНЕНИЙ С МОМЕНТА ПОСЛЕДНЕГО ОБНОВЛЕНИЯ РАСКРЫВАЕМОЙ ИНФОРМАЦИИ

В начале 2018 года Центральный депозитарий открыл банковские счета в Citibank N.A., London, в АО "Торгово-промышленный банк Китая в Алматы" и в АО ДБ "Банк Китая в Казахстане". Открытие данных счетов было связано с перспективой стать расчетным банком при допуске на торги иностранными валютами профессиональных участников рынка ценных бумаг, имеющих лицензию на осуществление брокерских и дилерских операций.

В феврале 2018 года небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" присвоило Центральному депозитарию международный код идентификации юридического лица (код LEI), используемый в соответствии с международным стандартом ISO 17442 при совершении операций и отчетности на финансовых рынках.

В марте 2018 года совместно с Национальным Банком внедрена в эксплуатацию система "Invest Online", позволяющая гражданам Республики Казахстан инвестировать денежные средства в ценные бумаги (ноты Национального Банка) в режиме онлайн с помощью мобильного приложения или на интернет-сайте системы "Invest Online". Для учета операций с ценными бумагами и подтверждения прав собственности по ним в системе "Invest Online" применена технология "блокчейн". Для расчетов по операциям с ценными бумагами Национальный Банк осуществил выпуск электронных денег.

Во исполнение пункта 3.3 Плана мероприятий по внедрению стандарта ISO 20022 "Финансовые услуги. Универсальная схема сообщений финансовой индустрии" в платежные системы Республики Казахстан на 2018–2022 годы Центральный депозитарий в 2018 году закупил консалтинговые услуги по разработке форматов сообщений для регистрации сделок и операций с финансовыми инструментами в соответствии с международным стандартом ISO 20022. Центральный депозитарий использует разработанные форматы в новой автоматизированной информационной системе "Депозитарно-регистраторская система по ценным бумагам" для регистрации и исполнения приказов клиентов Центрального депозитария в рамках регистраторской деятельности.

В 2019 году была осуществлена реорганизация Центрального депозитария путем присоединения к нему Единого регистратора с целью образования единой организации, которая потребовала коренных изменений в Своде правил. Свод правил в новой редакции отражает результаты анализа возможности и целесообразности различных вариантов комбинаций функций единой организации для получения синергетического эффекта и повышения уровня сервисного комфорта для клиентов Центрального депозитария, а именно:

- изменена процедура заключения договоров с клиентами: заключается один договор, в рамках которого клиент вправе воспользоваться услугами Центрального депозитария по различным видам его деятельности;

- упрощена процедура по переводу инструментов, выпущенных в соответствии с законодательством Республики Казахстан, между субсчетами, открытыми в рамках депозитарной деятельности, и лицевыми счетами, открытыми в системе реестров держателей ценных бумаг.

С 2019 года Центральный депозитарий оказывает услуги по ведению системы реестров, в том числе регистрации сделок и подтверждению прав по ценным бумагам и долям в уставных капиталах акционерным обществам, товариществам с ограниченной ответственностью, держателям ценных бумаг и участникам товариществ с ограниченной ответственностью, обслуживаемым в системе реестров.

С 2019 года идентификация всех ценных бумаг, выпускаемых в соответствии с законодательством Республики Казахстан, осуществляется по международному идентификационному номеру ISIN в соответствии с международным стандартом ISO 6166. В связи с этим в конце 2018 года Центральный депозитарий присвоил коды ISIN, CFI и FISN всем государственным и негосударственным ценным бумагам казахстанских эмитентов, находящимся в обращении.

В целях более эффективного взаимодействия Центрального депозитария с его клиентами в 2019 году введены в эксплуатацию личные кабинеты "Doc.KACD", "Эмитент" и "Держатель". Личный кабинет "Doc.KACD", сократив временные затраты, позволил клиентам Центрального депозитария обмениваться электронными документами (в том числе приказами, заявлениями, запросами и прочей информацией) с Центральным депозитарием. Вместе с тем эмитенты финансовых инструментов посредством личного кабинета "Эмитент" могут получать реестры держателей ценных бумаг, отчеты, выписки, справки и прочие информационные услуги, а также услугу платежного агента. В личном кабинете "Держатель" клиентам Центрального депозитария предоставлена возможность подачи и получения приказов и отчетных документов в электронном формате.

С 2019 года согласно закону Республики Казахстан "Об акционерных обществах" Центральный депозитарий приступил к осуществлению деятельности по учету невестребованных денег, полученных от эмитента или мажоритарного акционера.

Кроме того, в 2019 году в связи с запуском торгово-клиринговой системы ASTS+ и внедрением услуг ЦКА на фондовом рынке Центральный депозитарий произвел доработку своих информационных систем. В 2019 году введена в эксплуатацию внебиржевая котировочная система, представляющая собой онлайн-сервис для подачи и просмотра клиентами предложений о покупке/продаже финансовых инструментов.

В 2018 и 2019 годах Центральный депозитарий продолжил работу по совершенствованию системы управления рисками, в том числе, в соответствии с Принципами для инфраструктур финансового рынка, разработанными Комитетом по платежным и расчетным системам, и Международной организацией комиссий по ценным бумагам. Центральный депозитарий является инфраструктурной организацией и в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 23 декабря 2019 года № 240 относится к системно значимой инфраструктурной финансовой организации. В связи с этим Центральный депозитарий придает большое значение вопросам обеспечения своей финансовой устойчивости и непрерывности своей деятельности. В отчетных годах Центральный депозитарий продолжил совершенствование процедур мониторинга и контроля показателей финансовой устойчивости, и планов и процедур обеспечения непрерывности деятельности в соответствии с международной практикой. Для оценки эффективности

планов и процедур обеспечения непрерывности деятельности Центральный депозитарий проводит регулярное тестирование, направленное на определение возможности своевременного и надлежащего реагирования на различные инциденты, в том числе, с использованием резервного центра. Результаты тестирований, проведенных в 2018–2019 годах, свидетельствуют о надежности и эффективности процедур обеспечения непрерывности деятельности Центрального депозитария.

В качестве дополнительной меры управления рисками Центральный депозитарий ежегодно, начиная с 2013 года, осуществляет страхование рисков и имущества. И в 2018, и в 2019 годах Центральный депозитарий осуществил страхование своих рисков (профессиональной ответственности) на сумму 500 млн тенге и страхование имущества на сумму 193 млн тенге. Полисом страхования профессиональной ответственности покрыты риски, связанные с противоправными действиями, компьютерными преступлениями и сбоями, ошибками персонала, а также иные риски. Полисом страхования имущества покрыты риски, связанные с повреждением, полной гибелью и утратой имущества в результате пожара, удара молнии, взрыва, падения инородных предметов, противоправных действий третьих лиц и других стихийных бедствий техногенного и природного характера. За указанный период страховые случаи не возникали.

В рамках программы идентификации клиентов и программы мониторинга и изучения операций клиентов Центральный депозитарий продолжает осуществлять надлежащую проверку своих клиентов (их представителей) и бенефициарных собственников клиентов, и проводит соответствующий мониторинг операций клиентов на соответствие требованиям закона Республики Казахстан "О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма" от 28 августа 2009 года № 191-IV ЗРК и рекомендаций FATF (Группа разработки финансовых мер борьбы с отмыванием денег).

В 2020 году Центральный депозитарий разработал модуль "Номинальный держатель" системы "Личный кабинет", с помощью которого клиенты Центрального депозитария могут формировать приказы и запросы, получать отчеты, документы и иную информацию в электронном формате.

Вместе с тем в 2020 году Центральный депозитарий разработал и внедрил сервис по рассылке информационных сообщений держателям финансовых инструментов на указанные ими адреса электронной почты, с помощью которого в личных кабинетах на портале Центрального депозитария клиенты могут своевременно получать следующие информационные сообщения:

- 1) уведомление по заявкам внебиржевой котировочной системы о покупке инструментов;
- 2) уведомление по заявкам внебиржевой котировочной системы о продаже инструментов;
- 3) уведомление о включении в список для общего собрания акционеров;
- 4) уведомление о включении в список для выплаты вознаграждения по инструментам.

В связи с пандемией COVID-19 в 2020 году Центральный депозитарий принял необходимые меры по обеспечению непрерывности деятельности и выполнению своих функций в полном объеме в условиях режима чрезвычайного положения и далее в условиях карантина. В соответствии с требованиями уполномоченных органов часть работников была переведена на дистанционный режим работы, большая часть услуг была переведена в электронный формат, принимались меры по охране и защите здоровья работников Центрального депозитария, продолжавших деятельность в его офисах.

III. СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ ОБ ИФР

Общая информация об ИФР и обслуживаемых ею рынках

Виды деятельности и клиенты Центрального депозитария

В соответствии с законодательством Республики Казахстан Центральный депозитарий осуществляет следующие виды деятельности:

1) депозитарная деятельность:

оказание депонентам услуг номинального держания финансовых инструментов;

осуществление расчетов в финансовых инструментах по сделкам, заключенным на организованном рынке ценных бумаг, и по сделкам, заключенным на неорганизованном рынке ценных бумаг, с участием его депонентов (между самими депонентами; между депонентом, с одной стороны, и клиентом другого депонента, с другой стороны; между клиентами двух различных депонентов), а также иных клиентов;

осуществление депозитарного обслуживания государственных эмиссионных ценных бумаг в соответствии с законодательством Республики Казахстан и своим Сводом правил;

оказание консультационных, информационных услуг по вопросам, связанным с деятельностью на рынке ценных бумаг, а также других видов услуг, не противоречащих законодательству Республики Казахстан;

осуществление клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами или оказание услуг клиринговым организациям и (или) ЦКА организованного и (или) неорганизованного рынка ценных бумаг на условиях и в порядке, установленных нормативным правовым актом уполномоченного органа и своим Сводом правил;

2) ведение системы реестров держателей ценных бумаг и участников товариществ с ограниченной ответственностью:

формирование, ведение, хранение и закрытие системы реестров;

открытие лицевого счета в системе реестров зарегистрированному лицу;

регистрация сделок с финансовыми инструментами по лицевому счету зарегистрированного лица;

подтверждение прав по финансовым инструментам зарегистрированного лица;

поддержание системы реестров в актуальном состоянии;

осуществление контроля за соответствием количества ценных бумаг, находящихся в обращении на вторичном рынке ценных бумаг, количеству, зарегистрированному уполномоченным органом;

информирование держателей ценных бумаг по перечню вопросов, определенных Сводом правил;

предоставление эмитенту и товариществу с ограниченной ответственностью информации, составляющей систему реестров, на основании его запроса;

предоставление информации государственным органам, обладающим правом в соответствии с законодательными актами Республики Казахстан на получение сведений, составляющих систему реестров держателей ценных бумаг и участников товариществ с ограниченной ответственностью;

иные функции в соответствии с законодательными актами Республики Казахстан;

3) осуществление отдельных видов банковских операций:

функции централизованной организации, осуществляющей расчеты между клиентами Центрального депозитария;

выполнение функций платежного агента по выплате дохода по финансовым инструментам и при их погашении;

открытие банковских счетов клиенту, предназначенных для осуществления переводов денег по сделкам с эмиссионными ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, а также для получения денег при выплате дохода и погашении финансовых инструментов;

4) ведение системы реестров держателей государственных ценных бумаг;

5) присвоение международных идентификаторов (ISIN, CFI и FISN) ценным бумагам и другим финансовым инструментам;

6) формирование и ведение системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами, заключенных на организованном и неорганизованном рынках ценных бумаг;

7) присвоение идентификаторов правам требования;

8) деятельность по организации торговли ценными бумагами и иными финансовыми инструментами:

эксплуатация и поддержание интегрированной информационной системы внебиржевого рынка ценных бумаг;

предоставление своим клиентам доступа к интегрированной информационной системе внебиржевого рынка ценных бумаг;

организация обмена котировками ценных бумаг и иных финансовых инструментов между клиентами Центрального депозитария для заключения сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на неорганизованном рынке ценных бумаг;

организация обмена сообщениями о заключении сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами между клиентами Центрального депозитария;

иные функции, предусмотренные законом Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг";

9) осуществление деятельности по учету невостребованных денег.

Депозитарная деятельность

По состоянию на 01 января 2021 года в Центральном депозитарии было открыто 53 лицевых счета.

Количество субсчетов, открытых на лицевых счетах депонентов в Центральном депозитарии в 2020 году, увеличилось на 15 434 по сравнению с аналогичным показателем прошлого года и составило 136 573 субсчета, 53 из которых открыты на имена депонентов Центрального депозитария, а 136 520 – на имена клиентов депонентов, в том числе из них на имена физических лиц открыто 134 379 субсчетов, на резидентов открыто 135 464 субсчета, на нерезидентов – 1 046 субсчетов и 10 субсчетов с признаком резидентства "неизвестно". Общий объем финансовых инструментов в номинальном держании по состоянию на 01 января 2021 года составил 85,89 трлн тенге, что на 18,96 трлн тенге (28,33 %) больше аналогичного показателя прошлого года.

Объем государственных ценных бумаг в номинальном держании по состоянию на 01 января 2021 года составил 14,28 трлн тенге или 16,63 % от общего объема финансовых инструментов в номинальном держании, что по сравнению с аналогичным показателем прошлого года меньше на 0,12 %. Объем негосударственных ценных бумаг (без учета государственных пакетов акций) в номинальном держании по состоянию на 01 января 2021 года составил 11,78 трлн тенге или 13,72 % от общего объема финансовых инструментов в номинальном держании, что меньше прошлогоднего показателя на 1,64 %.

На 01 января 2021 года Центральный депозитарий имел счета номинального держания в следующих учетных организациях:

- Clearstream Banking, A.G., Frankfurt;
- Euroclear Bank S.A./N.V.;
- ЗАО "Центральный депозитарий" (Кыргызская Республика);
- Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" (Российская Федерация);
- Республиканское унитарное предприятие "Республиканский центральный депозитарий ценных бумаг" (Республика Беларусь);
- Частная компания "Центральный Депозитарий Биржи Международного Финансового Центра Астана".

На счетах номинального держания, открытых на имя Центрального депозитария в учетных организациях, на 01 января 2021 года было зарегистрировано финансовых инструментов на сумму 1,83 трлн тенге.

Функции платежного агента

При выполнении функций платежного агента по выплате дохода по финансовым инструментам Центральный депозитарий в 2020 году осуществил выплату дивидендов по акциям на общую сумму 37,46 млрд тенге и выплату вознаграждения по облигациям на общую сумму 1,51 млрд тенге.

При осуществлении эмитентами выплаты доходов по финансовым инструментам, выпущенным в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств, и погашения финансовых инструментов Центральный депозитарий в 2020 году перечислил держателям финансовых инструментов деньги:

- при выплате вознаграждения на суммы 75,20 млн долларов США, 1,22 млн евро, 316,12 млн российских рублей, 5 457,00 швейцарских франков, 36,80 млрд тенге;
- при выплате дивидендов на суммы 8,65 млн долларов США, 17,40 млн российских рублей, 1 296,00 канадских долларов;
- при погашении финансовых инструментов на суммы 0,83 млрд долларов США, 1,82 млрд тенге, 0,37 млрд российских рублей.

При осуществлении эмитентами государственных ценных бумаг выплаты вознаграждения и погашения Центральный депозитарий в 2020 году перечислил поступившие доходы на общую сумму 16,11 трлн тенге, что на 50,73 % меньше, чем в 2019 году.

Деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг

По состоянию на 01 января 2021 года в системе реестров Центрального депозитария заключен 1 071 договор по ведению системы реестров держателей ценных бумаг с эмитентами ценных бумаг, из которых 77 договоров заключены с эмитентами облигаций в форме ТОО и 994 договора с эмитентами в форме акционерных обществ. За отчетный год заключено 59 новых договоров, с 24 эмитентами договоры по ведению системы реестров держателей ценных бумаг были расторгнуты.

По состоянию на 01 января 2021 года в системе реестров зарегистрировано 1 858 реестров держателей (ISIN) негосударственных эмиссионных ценных бумаг, что на один меньше, чем на 01 января 2020 года. 116 реестров (ISIN) приняты на обслуживание в 2020 году, что на 58 меньше аналогичного показателя за 2019 год.

В 2020 году зарегистрировано 32 операции по погашению ценных бумаг, что равно количеству операций, зарегистрированных в предыдущем году и 53 операции по аннулированию выпуска ценных бумаг, что на 11 операций меньше по сравнению с 2019 годом.

Кроме того, по состоянию на 01 января 2021 года в системе реестров держателей ценных бумаг Центрального депозитария заключено 896 договоров по ведению реестра участников, из них 893 договора с ТОО, два договора с командитными товариществами и один договор с полным товариществом. В отчетном периоде был заключен 51 договор, а расторгнуто 40 договоров по ведению реестра участников с ТОО. По состоянию на 01 января 2021 года количество лицевых счетов держателей ценных бумаг в системе реестров уменьшилось на 2 281 по сравнению с аналогичным показателем прошлого года и составило 1 400 061.

Вместе с тем по состоянию на 01 января 2021 года количество лицевых счетов участников товариществ в системе реестров увеличилось на 5 760 по сравнению с прошлым годом и составило 383 510.

В 2020 году в системе реестров держателей ценных бумаг Центрального депозитария было зарегистрировано 13 209 операций с ценными бумагами, на общую сумму 7 038,31 млрд тенге, что больше аналогичного показателя прошлого года на 531 операцию (4,19 %) и 3 563,76 млрд тенге (50,63 %) соответственно. По сравнению с 2019 годом в отчетном году количество ценных бумаг по операциям с ценными бумагами уменьшилось на 3 908,81 млрд штук (31,78 %) и составило 1 820,73 млрд штук.

В 2020 году количество операций с долями хозяйственных товариществ уменьшилось на 34,14 % и составило 2 629. Объем операций с долями хозяйственных товариществ в отчетном периоде уменьшился на 48,49 % и составил 37,92 млрд тенге. По сравнению с 2019 годом количество и объем операций снизились на 1 363 штуки и 35,7 млрд тенге соответственно. По сравнению с прошлым годом в 2020 году Центральный депозитарий исполнил на 3 757 информационных операций меньше, что составило 22 094 информационных операции.

В течение отчетного года в Центральный депозитарий поступило 5 372 запроса на получение информации из системы реестров, 49 из которых от государственных органов, 16 от конкурсных и банкротных управляющих, 2 585 от частных судебных исполнителей, 2 028 от нотариусов, 62 от адвокатов, 321 от Национального Банка и 311 запросов от судов. По сравнению с 2019 годом количество запросов на получение информации из системы реестров в 2020 году увеличилось на 625.

В 2020 году Центральный депозитарий зарегистрировал 52 142 приказа и распоряжения на проведение операций в системе реестров, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 10 502 приказа и распоряжения. Кроме того, в текущем году Центральный депозитарий предоставил ответы на 15 949 письменных обращений зарегистрированных лиц, что по сравнению с прошлым годом больше на 12 153 обращения.

Осуществление отдельных видов банковских операций

По состоянию на 01 января 2021 года в Центральном депозитарии открыто 64 текущих счета, в том числе 27 текущих счетов, предназначенных для учета собственных денег депонентов; пять текущих счетов депонентов, с которыми расторгнуты договоры текущего счета, но на счетах которых имеются деньги; 27 текущих счетов, предназначенных для учета денег клиентов депонентов, а также пять текущих счетов депонентов, с которыми расторгнуты договоры текущего счета, но на счетах которых имеются деньги. Кроме того, открыто 53 корреспондентских счета, в том числе 27

корреспондентских счетов, предназначенных для учета собственных денег депонентов, и 26 корреспондентских счетов, предназначенных для учета денег клиентов депонентов и KASE.

По состоянию на 01 января 2021 года остаток на банковских счетах в национальной валюте составил 7,67 млрд тенге, из них 0,32 млрд тенге на собственных банковских счетах депонентов и 7,35 млрд тенге на клиентских банковских счетах депонентов и KASE.

В иностранной валюте остаток на банковских счетах клиентов по состоянию на 01 января 2021 года составил:

- в долларах США: 52,77 млн, из них 6,15 млн на собственных банковских счетах и 46,62 млн на клиентских банковских счетах;
- в евро: 0,91 млн на клиентских банковских счетах;
- в фунтах стерлингов Соединенного Королевства: 0,51 млн, из них 0,01 млн на собственных банковских счетах и 0,50 млн на клиентских банковских счетах;
- в российских рублях: 116,26 млн, из них 88,35 млн на собственных банковских счетах и 27,91 млн на клиентских банковских счетах;
- в швейцарских франках: 232,47 на клиентских банковских счетах;
- в канадских долларах: 1 296 на клиентских банковских счетах.

В 2020 году Центральный депозитарий осуществил 357 500 переводов денег на общую сумму 337,98 трлн тенге, в том числе:

- 195 669 переводов денег в национальной валюте по текущим позициям клиентов, открытым в МСПД, на общую сумму 315,16 трлн тенге;
- 136 678 переводов денег в национальной валюте по банковским счетам клиентов в Центральном депозитарии на общую сумму 19,62 трлн тенге;
- 25 153 перевода денег в иностранной валюте по банковским счетам, открытым в Центральном депозитарии, на общую сумму 3,20 трлн тенге.

За отчетный период Центральный депозитарий при регистрации сделок с финансовыми инструментами, заключенных на первичном и вторичном рынках, осуществил 214 702 перевода денег в национальной валюте на сумму 274,18 трлн тенге, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 82,42 трлн тенге (-23,11 %). Кроме того, в 2020 году Центральный депозитарий осуществил 1 635 переводов денег при регистрации сделок в иностранной валюте, в том числе 1 410 переводов денег при регистрации сделок с финансовыми инструментами в долларах США на сумму 1,95 млрд долларов США, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 3,65 млрд долларов США (-65,20 %); 45 переводов при регистрации сделок с финансовыми инструментами в евро на сумму 0,17 млрд евро, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 0,29 млрд евро (-62,54 %). В 2020 году было осуществлено четыре перевода денег при регистрации сделок с финансовыми инструментами в фунтах стерлингов Соединенного Королевства на сумму 5,28 млн фунтов стерлингов Соединенного Королевства, что больше аналогичного показателя 2019 года на 5,05 млн фунтов стерлингов Соединенного Королевства (2 260,11 %). Столь значительное увеличение переводов в английских фунтах стерлингов связано с вводом в номинальное держание Центрального депозитария иностранных ценных бумаг, выпущенных в английских фунтах стерлингов. В 2020 году было осуществлено 176 переводов денег при

регистрации сделок с финансовыми инструментами в российских рублях на сумму 1,82 млрд российских рублей, что больше аналогичного показателя 2019 года на 0,18 млрд российских рублей (10,82 %).

В 2020 году Центральный депозитарий осуществил 1 778 переводов денег в национальной валюте при выплате вознаграждения по финансовым инструментам на общую сумму 597,40 млрд тенге, что на 125,91 млрд тенге (26,71 %) больше, чем в прошлом году. Кроме того, в 2020 году Центральный депозитарий осуществил 2 197 переводов денег при выплате вознаграждения по финансовым инструментам в иностранной валюте, из них 2 155 переводов денег на общую сумму 75,20 млн долларов США, что на 29,60 млн долларов США (-28,25 %) меньше, чем в прошлом году; 20 переводов денег на общую сумму 0,32 млрд российских рублей, что на 0,18 млрд российских рублей (-36,62 %) меньше, чем в прошлом году, два перевода денег на общую сумму 5 457,00 швейцарских франков, 20 переводов денег на общую сумму 1,22 млн евро, что на 0,66 млн евро (118,55 %) больше, чем в 2019 году. Значительное увеличение переводов евро связано с вводом в номинальное держание Центрального депозитария иностранных ценных бумаг, выпущенных в евро.

В 2020 году Центральный депозитарий осуществил 59 991 перевод денег при выплате дивидендов в национальной валюте на общую сумму 37,46 млрд тенге, что на 1,83 млрд тенге (5,15 %) больше аналогичного показателя 2019 года. Кроме того, в 2020 году Центральный депозитарий осуществил 16 299 переводов денег при выплате дивидендов по финансовым инструментам в иностранной валюте, из них 10 916 переводов денег на общую сумму 8,65 млн долларов США, что на 1,58 млн долларов США (22,41 %) больше, чем в 2019 году; 5 379 переводов денег на общую сумму 17,40 млн российских рублей, что на 3,45 млн российских рублей (-16,55 %) меньше, чем в 2019 году и четыре перевода денег на сумму 1 296 канадских долларов.

При погашении финансовых инструментов Центральный депозитарий в 2020 году осуществил 1 661 перевод денег в национальной валюте на общую сумму 15,55 трлн тенге, что на 16,69 трлн тенге (-51,76 %) меньше, чем в 2019 году. В иностранной валюте Центральный депозитарий в 2020 году при погашении финансовых инструментов осуществил 155 переводов, из них 146 переводов в долларах США на сумму 0,83 млрд долларов США, что на 0,70 млрд долларов США (525,26 %) больше, чем в 2019 году; девять переводов в российских рублях на сумму 0,37 млн российских рублей, что на 0,31 млрд российских рублей (457,82 %) больше, чем в 2019 году. Столь значительное увеличение переводов на 525,26 % в долларах США и на 457,82 % в российских рублях связано с вводом в номинальное держание Центрального депозитария иностранных ценных бумаг, выпущенных в долларах США и российских рублях соответственно. По состоянию на 01 января 2021 года остатки на счете для учета не востребовавшихся денег составили: 11,04 трлн тенге и 14 200,08 долларов США. За 2020 год эмитенты перечислили в Центральный депозитарий 3,84 млрд тенге, мажоритарные акционеры перечислили 3,81 млрд тенге и 14 200,08 долларов США. В свою очередь Центральный депозитарий осуществил 879 переводов не востребовавшихся денег в тенге идентифицированным бенефициарам: 878 переводов на сумму 0,55 млрд тенге и один перевод на сумму 0,85 млн долларов США.

Деятельность по формированию и ведению системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами

С 01 января по 31 декабря 2020 года посредством личного кабинета "Информирующее лицо" принято 8 307 электронных сообщений информирующих лиц, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 618 электронных сообщений, из них:

- 1 551 (больше на 1 483, чем в 2019 году) отклонено по причине недопустимого формата, технических ошибок, допущенных информирующими лицами, либо другой ошибки;
- 6 756 (меньше на 2 101, чем в 2019 году) обработано.

Присвоение идентификаторов ценным бумагам и другим финансовым инструментам

В период с 01 января по 31 декабря 2020 года Центральный депозитарий присвоил 361 код ISIN, что меньше аналогичного показателя 2019 года на 262 кода, и одновременно с ними 361 код CFI и 361 код FISN, и аннулировал 231 код ISIN, что на 42 кода меньше, чем в 2019 году. По состоянию на 01 января 2021 года общее количество действующих кодов ISIN, присвоенных финансовым инструментам, выпущенным в соответствии с законодательством Республики Казахстан, составило 3 228, что больше по сравнению с 2019 годом на 489 кодов (полный список кодов ISIN, присвоенных Центральным депозитарием, по состоянию на 01 число месяца, ежемесячно публикуется на официальном интернет-сайте Центрального депозитария). В период с 01 января по 31 декабря 2020 Центральный депозитарий присвоил один идентификатор, что больше аналогичного показателя прошлого года, в котором был присвоен один идентификатор.

Общая организация ИФР

Центральный депозитарий является дочерней организацией Национального Банка.

Состав акционеров Центрального депозитария по состоянию на 01 октября 2021 года:

№ п/п	Наименование акционера	Доля от общего количества размещенных акций, %
1.	Национальный Банк	63,83
2.	KASE	29,55
3.	Банки второго уровня	5,03
4.	Брокерские компании	1,57

Органами Центрального депозитария являются общее собрание акционеров, Совет директоров и Правление.

Совет директоров избирается общим собранием акционеров Центрального депозитария и состоит из семи человек. В Совет директоров входят независимые директора, представитель государственного органа, осуществляющего регулирование рынка ценных бумаг.

Правление состоит из четырех человек: председателя Правления и заместителей председателя Правления.

Законодательная и нормативная база

Центральный депозитарий является специализированной некоммерческой организацией, единственной на территории Республики Казахстан осуществляющей депозитарную деятельность и деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг. Регулирование, контроль и надзор за деятельностью Центрального депозитария осуществляется уполномоченным органом.

Депозитарная деятельность, деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг, деятельность по организации торговли с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, клиринговая деятельность по сделкам с финансовыми инструментами, осуществляется Центральным депозитарием в соответствии с законодательством Республики Казахстан без лицензии уполномоченного органа.

На основании лицензии уполномоченного органа осуществляет следующие виды банковских операций:

- 1) открытие и ведение банковских счетов юридических лиц;
- 2) открытие и ведение корреспондентских счетов банков и организаций, осуществляющих отдельные виды банковских операций;
- 3) переводные операции: выполнение поручений юридических лиц по платежам и переводам денег.

Деятельность Центрального депозитария регулируется в соответствии с законами Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", "О рынке ценных бумаг", "Об акционерных обществах" и другими законами.

Основные условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности регламентированы следующими, но не ограничиваясь ими, подзаконными нормативными правовыми актами Республики Казахстан и внутренними документами Центрального депозитария, являющимися обязательными для клиентов Центрального депозитария:

- 1) постановление Правления Национального Банка "Об утверждении Правил осуществления деятельности центрального депозитария" от 29 ноября 2018 года № 307;
- 2) постановление Правления Национального Банка "Об утверждении Правил регистрации сделок с эмиссионными ценными бумагами в системе учета номинального держания ценных бумаг, предоставления номинальным держателем выписки с лицевого счета держателя ценных бумаг в системе учета номинального держания ценных бумаг и раскрытия информации номинальным держателем" от 22 октября 2014 года № 210;
- 3) постановление Правления Национального Банка "Об утверждении Требований по наличию системы управления рисками в центральной депозитарии" от 28 декабря 2018 года № 318;
- 4) Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан "Об утверждении Правил осуществления деятельности по ведению системы реестра держателей ценных бумаг" от 29 октября 2018 года № 249;
- 5) Свод правил.

В соответствии с требованиями пункта 8 Правил осуществления деятельности центрального депозитария, утвержденных постановлением Правления Национального Банка от 29 ноября 2018 года № 307, организационная структура центрального депозитария включает отдельные подразделения, осуществляющие:

- 1) депозитарную деятельность;
- 2) переводы денег при регистрации сделок с финансовыми инструментами, при выплате дохода по финансовым инструментам и при их погашении, а также открытие и ведение текущих счетов для учета и хранения денег депонентов и их клиентов;
- 3) ведение системы реестров держателей ценных бумаг и реестра участников товарищества с ограниченной ответственностью;
- 4) клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами;
- 5) управление рисками;
- 6) внутренний аудит.

Кроме того, в Центральном депозитарии для принятия инвестиционных решений по осуществлению сделок с финансовыми инструментами за счет собственных активов функционирует Инвестиционный комитет.

Центральный депозитарий совместно с KASE является учредителем ТОО "РТРС". Доля участия Центрального депозитария в уставном капитале ТОО "РТРС" составляет 50 %. ТОО "РТРС" является организацией, осуществляющей техническое сопровождение деятельности Центрального депозитария (резервный технический центр).

Центральный депозитарий в соответствии с постановлением Правления Национального Банка "Об утверждении перечня, форм, сроков отчетности центрального депозитария и правил их представления" от 29 октября 2018 года № 263 еженедельно, ежеквартально и ежемесячно представляет отчеты о своей деятельности в уполномоченный орган. Кроме того, предусмотрены иные виды отчетов в уполномоченный орган, в том числе финансовая отчетность, отчеты по системе управления рисками и другие.

Структура и функции системы

Центральный депозитарий использует следующие типы расчетов:

Неорганизованный рынок:

DVP (модель-1), расчётный цикл T+0, T+n;

FOF расчётный цикл T+0, T+n.

Организованный рынок:

на нетто-основе по сделкам с финансовыми инструментами с участием ЦКА

DVP (модель-2), расчётный цикл T+2;

на gross-основе по сделкам с финансовыми инструментами без участия ЦКА

DVP (модель-1), расчётный цикл T+0.

Регистрация сделки или иной операции с финансовыми инструментами, выпущенными в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств, по счету Центрального депозитария в учетной организации осуществляется в соответствии с правилами учетной организации.

Регистрация сделок с финансовыми инструментами предусматривает перевод финансовых инструментов и/или перевод денег в случаях, предусмотренных Сводом правил.

Порядок перевода денег при регистрации сделок с финансовыми инструментами устанавливается Правилами осуществления банковских операций.

Центральный депозитарий осуществляет регистрацию сделок с финансовыми инструментами, заключенных на организованном или неорганизованном рынке.

В случае если исполнение принятого Центральным депозитарием приказа (принятых Центральным депозитарием встречных приказов) на регистрацию сделки (операции) с финансовыми инструментами не связано с необходимостью перевода денег согласно Своду правил, Центральный депозитарий исполняет данный приказ (данные приказы) путем перевода финансовых инструментов с того раздела субсчета отправителя на тот раздел субсчета получателя, которые соответствуют характеру этой сделки (операции).

В случае если исполнение принятого Центральным депозитарием приказа (принятых Центральным депозитарием встречных приказов) на регистрацию сделки (операции) с финансовыми инструментами связано с необходимостью перевода денег согласно Своду правил, Центральный депозитарий:

- 1) переводит финансовые инструменты с раздела субсчета отправителя, который соответствует виду этой сделки (операции), на раздел "расчеты" того же субсчета;
- 2) переводит деньги в порядке, установленном Правилами осуществления банковских операций.

Центральный депозитарий регистрирует сделки купли-продажи инструментов, связанные с переводом денег, только по субсчетам, открытым на лицевых счетах депонентов.

Центральный депозитарий направляет отчет об исполнении или неисполнении приказа на регистрацию сделки (операции) с финансовыми инструментами, заключенной (осуществленной) на организованном рынке, организатору торгов.

Центральный депозитарий направляет отчет о зарегистрированных сделках (операциях) с финансовыми инструментами депонентам, субсчета которых указаны в исполненном приказе на регистрацию сделки (операции) с финансовыми инструментами, заключенной (осуществленной) на организованном рынке.

Центральный депозитарий направляет отчет об исполнении или неисполнении приказа (встречных приказов) на регистрацию сделки (операции) с финансовыми инструментами, заключенной (осуществленной) на неорганизованном рынке, депоненту (клиенту депонента), субсчет которого указан в данном приказе, депонентам (клиентам депонентов), субсчета которых указаны в данных приказах).

IV. КРАТКОЕ ИЗЛОЖЕНИЕ РАСКРЫВАЕМОЙ ИНФОРМАЦИИ ПО ПРИНЦИПАМ

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 1. Правовая основа ИФР должна иметь хорошо обоснованную, четко сформулированную, прозрачную и обеспеченную правовой санкцией юридическую базу для каждого существенного аспекта своей деятельности во всех соответствующих юрисдикциях</p>		
<p>Ключевое соображение 1. Правовая основа должна обеспечивать высокую степень определенности по каждому существенному аспекту деятельности ИФР во всех соответствующих юрисдикциях.</p>	Соблюдается	<p>Правовая основа деятельности Центрального депозитария охватывает полный спектр услуг Центрального депозитария, включая:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) оказание услуг номинального держания другим номинальным держателям и участникам рынка ценных бумаг, имеющим право открывать в Центральном депозитарии лицевые счета; 2) осуществление расчетов в финансовых инструментах по сделкам, заключенным на организованном и неорганизованном рынках ценных бумаг; 3) осуществление депозитарного обслуживания государственных эмиссионных ценных бумаг; 4) осуществление функций централизованной организации, осуществляющей расчеты между брокерами и дилерами; 5) выполнение функций платежного агента по выплате доходов по финансовым инструментам и при их погашении; 6) открытие банковских счетов; 7) осуществление клиринговой деятельности; 8) осуществление деятельности по ведению системы реестров держателей ценных бумаг и участников товариществ с ограниченной ответственностью; 9) ведение системы реестров держателей государственных ценных бумаг; 10) ведение системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами; 11) осуществление деятельности по учету невостребованных денег; 12) оказание консультационных, информационных и других видов услуг, не противоречащих законодательству Республики Казахстан. <p>Законодательство Республики Казахстан запрещает Центральному депозитарию осуществление предпринимательской деятельности, не относящейся к деятельности на финансовом рынке.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
Ключевое соображение 2. ИФР должна иметь правила, процедуры и контракты, четко сформулированные, понятные и соответствующие действующему законодательству и нормативным документам.	Соблюдается	Правила и процедуры Центрального депозитария для своих клиентов устанавливаются Сводом правил, соблюдение которого является обязательным для всех субъектов, пользующихся услугами Центрального депозитария. Свод правил утверждается Советом директоров. Документы Свода правил, типовые формы приказов и заявлений размещаются на интернет-сайте Центрального депозитария и являются общедоступными.
Ключевое соображение 3. ИФР должна иметь возможность четко и понятно определить правовую основу своей деятельности для соответствующих компетентных органов, участников, и, при необходимости, клиентов участников.	Соблюдается	Правовая основа деятельности Центрального депозитария определена законами и подзаконными нормативными правовыми актами Республики Казахстан. При разработке и утверждении Свода правил и (или) изменений и дополнений в него проводится соответствующая работа по минимизации правовых и комплаенс-рисков для деятельности Центрального депозитария и приведению его в соответствие с законодательством Республики Казахстан.
Ключевое соображение 4. ИФР должна иметь правила, процедуры и контракты, имеющие исковую силу во всех соответствующих юрисдикциях. Необходима высокая степень определенности в том, что действия, предпринятые ИФР на основании таких правил и процедур, не будут приостановлены, признаны недействительными или иметь обратную силу.	Соблюдается	Согласно закону Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг" условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности на рынке ценных бумаг устанавливаются настоящим законом, нормативными правовыми актами уполномоченного органа и внутренними документами – Сводом правил, при этом Свод правил определяет взаимоотношения Центрального депозитария с субъектами рынка ценных бумаг. Соблюдение Свода правил является обязательным для всех субъектов, пользующихся услугами Центрального депозитария. Центральный депозитарий, помимо договоров в Республике Казахстан, имеет договорные отношения в рамках юрисдикции Российской Федерации, Европейского Союза, Республики Армения, Кыргызской Республики и Республики Беларусь.
Ключевое соображение 5. ИФР, осуществляющая деятельность в нескольких юрисдикциях, должна выявлять и смягчать риски, вызванные потенциальным конфликтом правовых норм разных юрисдикций.	Соблюдается	Правовая основа деятельности Центрального депозитария определена законами и подзаконными нормативными правовыми актами Республики Казахстан. При разработке и утверждении Свода правил и (или) изменений и дополнений в него проводится соответствующая работа по минимизации правовых рисков для деятельности Центрального депозитария и приведению его в соответствие с законодательством Республики Казахстан.

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 2. Управление ИФР должна иметь четкую и прозрачную систему управления, обеспечивающую безопасность и эффективность ИФР, а также стабильность финансовой системы в более широком смысле, другие аспекты, представляющие общественный интерес, и достижение целей заинтересованных сторон.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь цели, предусматривающие первоочередное обеспечение безопасности и эффективности ИФР, и в явной форме поддерживать финансовую стабильность и другие аспекты, представляющие общественный интерес.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Центральный депозитарий определил в качестве основной цели своего развития на 2022–2024 годы формирование на базе Центрального депозитария гибкой экосистемы на фондовом рынке, обслуживающей обращение финансовых активов широкого спектра и оказывающей инвесторам и другим участникам рынка широкий перечень услуг, связанных с операциями с ними, включая, но не ограничиваясь, следующими услугами:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) учет и хранение ценных бумаг и иных финансовых инструментов; 2) расчеты по биржевым и внебиржевым операциям с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами; 3) организация торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на внебиржевом рынке ценных бумаг; 4) оказание услуг по обработке корпоративных действий и раскрытию инвесторам информации о корпоративных событиях; 5) запуск платформы для проведения операций по предоставлению займов ценными бумагами; 6) оказание услуг по проведению идентификации и надлежащей проверки клиентов – профессиональных участников рынка ценных бумаг в рамках процедур противодействия отмыванию денег и финансирования терроризма. <p>Направления развития бизнес-стратегии содержат стратегические инициативы по развитию деятельности Центрального депозитария в качестве инфраструктурной организации финансового рынка, направленные на развитие инфраструктуры фондового рынка Казахстана и увеличение доли присутствия иностранных и локальных инвесторов на внутреннем рынке.</p> <p>Данные направления развития разделены на шесть стратегических и четыре операционных направлений деятельности, призванных расширить и улучшить качество оказываемого сервиса, упростить доступ инвесторов на рынок ценных бумаг, повысить уровень их информированности, предоставить дополнительные услуги иностранным инвесторам, а также обеспечить развитие внебиржевого рынка ценных бумаг Республики Казахстан: депозитарная деятельность, деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг и иных финансовых</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должны иметь документально закрепленные соглашения об управлении, четко и ясно определяющие обязанности и ответственность. Эти соглашения должны быть доведены до сведения владельцев, соответствующих компетентных органов, участников, и, на более широком уровне, общественности.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>инструментов, отдельные виды банковских операций, организация торгов на внебиржевом рынке ценных бумаг, хаб корпоративных действий, развитие экосистемы услуг, цифровизация деятельности Центрального депозитария, принципы финансирования деятельности Центрального депозитария и тарифная политика, совершенствование системы корпоративного управления и контрольной среды, развитие человеческих ресурсов.</p> <p>Для обеспечения финансовой стабильности Центральный депозитарий принимает меры по поддержанию адекватного размера собственного капитала и необходимого объема ликвидных активов, меры по управлению рисками (в том числе осуществляет страхование рисков), а также реализует иные мероприятия, направленные на обеспечение своей финансовой устойчивости.</p> <p>Структура управления Центрального депозитария определена законами Республики Казахстан "Об акционерных обществах", "О рынке ценных бумаг", иными нормативными правовыми актами, уставом и внутренними документами Центрального депозитария. Указанными документами подробно определены функции и полномочия общего собрания акционеров, Совета директоров и его комитетов, Правления и Службы внутреннего аудита Центрального депозитария. Кроме того, определены требования к должностным лицам Центрального депозитария.</p> <p>Информация о структуре управления Центрального депозитария является публичной и общедоступной.</p>
<p>Ключевое соображение 3. Роль и обязанности совета директоров (или другого аналогичного органа) ИФР должны быть точно определены; должны быть приняты документально закрепленные процедуры, регулирующие его деятельность, в том числе процедуры по выявлению, рассмотрению и урегулированию конфликтов интересов между членами. Совет директоров должен регулярно проводить проверку деятельности совета в целом и работу его отдельных членов.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Функции и полномочия Совета директоров определены законами Республики Казахстан "Об акционерных обществах", "О рынке ценных бумаг", иными нормативными правовыми актами, уставом и внутренними документами Центрального депозитария.</p> <p>Центральным депозитарием установлены процедуры управления существующими и потенциальными конфликтами интересов, в рамках которых налажен процесс выявления, исследования и разрешения конфликтов интересов участников; определены необходимые требования к соблюдению в рамках работы коллегиальных органов, должностных лиц и работников Центрального депозитария.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 4. В состав совета директоров должны входить квалифицированные члены, имеющие знания и мотивацию для выполнения своих многочисленных обязанностей. Как правило, это подразумевает включение в совет неисполнительных членов (члена)</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Акционеры обеспечивают выполнение требований к навыкам и мотивации членов Совета директоров путем избрания членов, обладающих значительным опытом в банковской, финансовой и научной сферах, высоким уровнем профессиональной и личной репутации.</p> <p>Порядок избрания членов Совета директоров закреплен в Положении о Совете директоров.</p> <p>Информация о каждом члене Совета директоров размещена на интернет-сайте Центрального депозитария.</p> <p>Система мотивации членов Совета директоров – независимых директоров стимулирует принимать активное участие в его заседаниях и заседаниях его комитетов. Годовой размер вознаграждения членов Совета директоров выплачивается согласно Правилам вознаграждения членов Совета директоров – независимых директоров и оплаты их расходов.</p>
<p>Ключевое соображение 5. Роли и обязанности руководства должны быть четко определены. Руководители ИФР должны обладать опытом, разнообразными навыками и профессиональной честностью, необходимыми для исполнения ими своих обязанностей, в целях руководства деятельностью и управления рисками ИФР</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Требования к членам исполнительного органа определены законами Республики Казахстан "Об акционерных обществах", "О рынке ценных бумаг", иными нормативными правовыми актами, уставом и внутренними документами Центрального депозитария.</p> <p>Руководители Центрального депозитария обладают соответствующим опытом, разнообразными навыками и профессиональной честностью, необходимыми для исполнения ими своих обязанностей, в целях руководства деятельностью Центрального депозитария. Вместе с тем руководители Центрального депозитария имеют высшее образование, трудовой стаж в финансовых организациях, и (или) в сфере регулирования финансовых услуг и (или) услуг по проведению аудита финансовых организаций, и безупречную деловую репутацию.</p>
<p>Ключевое соображение 6. Совет директоров должен создать четкую, документально оформленную систему управления рисками, включающую в себя политику толерантности к рискам ИФР, определяющую обязанности и ответственность за выполнение решений в области рисков и регулируемую процесс принятия решений в кризисной и чрезвычайной ситуации. Механизмы управления должны</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Совет директоров отвечает за установление общих принципов управления рисками и контролирует их реализацию. Советом директоров утверждена Политика управления рисками. Совет директоров регулярно рассматривает отчеты, содержащие анализ соответствующих рисков.</p> <p>Подразделение комплаенс-контроля имеет официальный статус, соответствующее положение, полномочия и независимость. Подотчетность, статус, полномочия и независимость регламентируются внутренними нормативными документами Центрального депозитария. Независимость на практике обеспечивается подотчетностью главного комплаенс-контролера Совету директоров. Служба комплаенс контроля имеет доступ к любой информации, необходимой для</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>обеспечивать, чтобы подразделения управления рисками и внутреннего контроля имели достаточно полномочий, независимости, ресурсов и доступ к совету директоров.</p>		<p>осуществления функций по управлению комплаенс-риском, в рамках возложенных на нее полномочий, а также достаточные ресурсы для выполнения данным подразделением поставленных задач.</p>
<p>Ключевое соображение 7. Совет директоров должен обеспечить, чтобы структура, правила, общая стратегия и основные решения ИФР надлежащим образом отражали законные интересы ее прямых и косвенных участников и других заинтересованных сторон. Информацию об основных решениях необходимо в четкой форме доводить до сведения заинтересованных сторон, а в случае широкомасштабного воздействия на рынок – до сведения общественности.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Информация о решениях Центрального депозитария, влияющих на его акционеров и заинтересованные стороны, доводится до их сведения путем опубликования на интернет-сайтах Центрального депозитария и Депозитария финансовой отчетности, и направления писем и иными доступными способами.</p> <p>Для учета интересов участников и других заинтересованных сторон Центрального депозитария приняты следующие (но не ограничиваясь ими) меры:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) в состав Совета директоров входят независимые директора; 2) обеспечена возможность получения предложений от участников рынка ценных бумаг, являющихся членами ОЮЛ "Ассоциация финансистов Казахстана"; 3) обеспечена возможность получения предложений от членов Консультативного совета, являющихся участниками рынка ценных бумаг.
<p>Принцип 3. Система комплексного управления рисками ИФР должна иметь устойчивую систему риск-менеджмента для комплексного управления правовым и кредитным рисками, риском ликвидности, операционным и другими рисками.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь политику риск-менеджмента, процедуры и системы управления рисками, позволяющие выявлять, количественно оценивать, проводить мониторинг и управлять всем спектром рисков, создаваемых ИФР и испытываемых ими. Необходимо периодически проводить пересмотр системы управления рисками.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Центральный депозитарий разработал и внедрил политику и правила управления рисками, которые охватывают все виды рисков, присущих деятельности Центрального депозитария (операционные, кредитные, рыночные, правовые, репутационные, а также риск потери ликвидности). Названные документы определяют подходы Центрального депозитария к оценке, контролю и мониторингу рисков. Ежегодно Центральный депозитарий осуществляет оценку соответствия системы управления рисками требованиям уполномоченного органа. Регулярная оценка эффективности системы управления рисками осуществляется в рамках внутреннего аудита. Внутренние документы по вопросам управления рисками пересматриваются Центральным депозитарием по мере необходимости, в том числе при выявлении недостатков в системе управления рисками, внедрении новых услуг и изменений в деятельности Центрального депозитария, а также в иных случаях.</p> <p>Риски, создаваемые для Центрального депозитария участниками, ограничены тем,</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна создавать для своих участников и, при необходимости, их клиентов стимулы для управления и снижения рисков, которые они создают для ИФР.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>что участники (резиденты Республики Казахстан) являются объектами надзора и регулирования со стороны уполномоченного органа. При этом уполномоченным органом для данных организаций установлены пруденциальные нормативы, требования к системам управления рисками и внутреннего контроля, а также иные обязательные требования.</p> <p>В рамках стимулирования участников и их клиентов к управлению и снижению рисков Центральным депозитарием приняты следующие, но не ограничиваясь ими, меры:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) внедрены и функционируют информационные системы, которые позволяет участникам обладать информацией о состоянии счетов, ходе и результатах сделок (операций) и другими данными, позволяющими контролировать риски; 2) договорами, заключенными между Центральным депозитарием и депонентами, предусмотрена ответственность депонентов перед Центральным депозитарием, в том числе в случае неисполнения установленных обязанностей; 3) на интернет-сайте Центрального депозитария размещена информация о системе управления рисками Центрального депозитария, включая информацию о мерах, принятых для обеспечения непрерывности деятельности.
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна регулярно проводить обзор существенных рисков, которые она испытывает и создает для других организаций (например, для других ИФР, расчетных банков, провайдеров ликвидности и провайдеров услуг), вследствие взаимозависимости, и создавать надлежащие механизмы управления рисками.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В целях минимизации рисков, создаваемых Центральным депозитарием, а также испытываемых от других ИФР, Центральным депозитарием приняты следующие меры:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) построена адекватная система управления рисками и обеспечения финансовой устойчивости; 2) установлены критерии выбора обслуживающих банков и депозитариев; 3) ежегодно осуществляется страхование рисков (профессиональной ответственности) Центрального депозитария; 4) внедрена система управления непрерывностью деятельности, эффективность функционирования которой проверяется в ходе регулярных тестирований. <p>В целях обеспечения непрерывности деятельности Центральный депозитарий разработал и утвердил Политику управления непрерывностью деятельности, планы обеспечения непрерывности деятельности и управления инцидентами, которые регламентируют порядок действий и восстановления деятельности Центрального депозитария в случае реализации непредвиденных событий. Ежегодно проводятся</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 4. ИФР должна выявлять сценарии, потенциально способные затруднить осуществление ИФР критически важных операций и оказание услуг на непрерывной основе, и оценивать результативность полного спектра возможностей для планирования восстановления или упорядоченного прекращения функционирования. ИФР должна подготовить планы по возобновлению деятельности или упорядоченной ликвидации на основании результатов оценки. При необходимости ИФР также должна предоставить соответствующим компетентным органам информацию, необходимую для планирования решений.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>тестирования процедур обеспечения непрерывности деятельности.</p> <p>В целях обеспечения непрерывности деятельности Центральный депозитарий разработал и утвердил планы обеспечения непрерывности деятельности и управления инцидентами, в которых определены сценарии, потенциально способные затруднить деятельность Центрального депозитария, а также проводит тестирование процедур обеспечения непрерывности деятельности для оценки их эффективности.</p>

Принцип 4. Кредитный риск

ИФР должна обеспечивать эффективное измерение, проводить мониторинг и управлять своими кредитными рисками, создаваемыми участниками, а также ее платежными, клиринговыми и расчетными процессами. ИФР должна поддерживать достаточные финансовые ресурсы, покрывающие ее кредитные риски, создаваемые каждым из участников, в полном объеме и с высокой степенью уверенности. Кроме того, ЦКА, ведущий деятельность с более сложным профилем риска или являющийся системно значимым в нескольких юрисдикциях, должен поддерживать дополнительные финансовые ресурсы, достаточные для покрытия широкого спектра потенциальных стрессовых сценариев, включающих, но не ограничивающихся, дефолтом двух крупнейших участников и их аффилированных лиц, потенциально способных вызвать наибольший совокупный кредитный риск у ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Все другие ЦКА должны поддерживать общие финансовые ресурсы, по меньшей мере, достаточные для покрытия дефолта одного из участников или его аффилированного лица, потенциально способных вызвать наибольший совокупный кредитный риск у ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях.

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна создать надежную структуру управления кредитными рисками, создаваемыми ее участниками, и кредитными рисками, создаваемыми ее платежными, клиринговыми и расчетными процессами. Кредитный риск может быть вызван текущими рисками, потенциальными будущими рисками или обоими видами рисков одновременно.</p>	Не применимо	Положения данного принципа не применимы к Центральному депозитарию, поскольку Центральный депозитарий не осуществляет функции ЦКА.
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна выявлять источники кредитного риска, постоянно проводить количественную оценку и мониторинг кредитных рисков и использовать надлежащие инструменты управления рисками для контроля этих рисков.</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 3. Платежная система или СРЦБ должна покрывать свои текущие и, при их наличии, потенциальные будущие риски, создаваемые каждым из участников, в полном объеме и с высокой степенью уверенности, при помощи залогового обеспечения и других аналогичных финансовых ресурсов (см. Принцип 5 о залоговом обеспечении). В случае платежных систем с отсроченными нетто-расчетами или СРЦБ с отсроченными нетто-расчетами, где не существует гарантии расчета, но участники подвержены кредитным рискам, созданным их платежными, клиринговыми и расчетными процессами, ИФР должна поддерживать, по меньшей мере, достаточные ресурсы для</p>	Не применимо	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>покрытия рисков со стороны двух участников и их аффилированных лиц, способных вызвать наибольший совокупный кредитный риск в системе.</p>		
<p>Ключевое соображение 4. ЦКА должен покрывать свои текущие и потенциальные будущие риски, создаваемые каждым из участников, в полном объеме и с высокой степенью уверенности, используя гарантийные депозиты и другие предоплаченные финансовые ресурсы (см. Принцип 5 о залоговом обеспечении и Принцип 6 о гарантийном депозите). Кроме того, ЦКА, ведущий деятельность с более сложным профилем риска или являющийся системно значимым в нескольких юрисдикциях, должен поддерживать дополнительные финансовые ресурсы, достаточные для покрытия широкого спектра потенциальных стрессовых сценариев, включающих, но не ограничивающихся, невыполнением обязательств двумя крупнейшими участниками и их аффилированными лицами, потенциально способных вызвать наибольший совокупный кредитный риск у ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Все другие ЦКА должны поддерживать дополнительные финансовые ресурсы, достаточные для покрытия широкого спектра потенциальных стрессовых сценариев, которые должны включать, но не ограничиваться, дефолтом одного участника и его аффилированного лица, потенциально</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>способных вызвать наибольший совокупный кредитный риск у ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Во всех случаях ЦКА должен документально оформить обоснование величины поддерживаемых им совокупных финансовых ресурсов и иметь соответствующие механизмы управления ими.</p>		
<p>Ключевое соображение 5. ЦКА должен регулярно определять объем и проверять достаточность своих совокупных финансовых ресурсов, доступных в случае невыполнения обязательств одним или несколькими участниками в экстремальных, но вероятных рыночных условиях, посредством строгого стресс-тестирования. ЦКА должен иметь четкие процедуры отчетности о результатах стресс-тестов перед соответствующими органами ЦКА, принимающими решения, и использовать результаты для оценки адекватности и изменения величины своих совокупных финансовых ресурсов. Стресс-тесты должны проводиться ежедневно с применением стандартов и предварительно установленных параметров и допущений. Не реже одного раза в месяц ЦКА должен выполнять всесторонний и исчерпывающий анализ используемых сценариев, моделей, базовых параметров и допущений стресс-тестирования для обеспечения их адекватности при определении требуемого уровня защиты ЦКА от дефолта в свете существующих и возникающих рыночных условий. ЦКА должен проводить</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>такой анализ адекватности стресс-тестирования чаще, если продукты, по которым осуществляется клиринг, или обслуживаемые рынки демонстрируют высокую волатильность, становятся менее ликвидными, а также, если размер или концентрация позиций участников ЦКА существенно возрастает. Полная валидация модели управления рисками ЦКА должна выполняться не реже одного раза в год.</p>		
<p>Ключевое соображение 6. При проведении стресс-тестирования ЦКА должен учитывать последствия широкого спектра соответствующих стресс-сценариев в том, что касается как позиций лиц, не исполняющих обязательства, так и возможных ценовых изменений в периоды ликвидации. Сценарии должны учитывать пиковые значения исторической волатильности цен, изменения других рыночных факторов, таких как ценовые детерминанты и кривые доходности, множественные случаи дефолта в различные периоды времени, одновременное давление на рынках финансов и активов, а также ряд перспективных стресс-сценариев в разнообразных экстремальных, но вероятных рыночных условиях.</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 7. ИФР должна установить четкие правила и процедуры полного покрытия кредитных потерь, которые она несет в результате индивидуального или комбинированного дефолта ее участников в отношении их обязательств перед ИФР. Эти правила и процедуры должны регулировать распределение потенциальных непокрытых кредитных потерь, включая возврат средств, заимствованных ИФР у провайдеров ликвидности. Эти правила и процедуры также должны определять процесс пополнения ИФР финансовых ресурсов, которые она задействует в случае стрессового события, так, чтобы ИФР могла продолжать работу безопасным и надежным образом.</p>	Не применимо	
<p>Принцип 5. Залоговое обеспечение ИФР, нуждающаяся в залоговом обеспечении для управления своим кредитным риском и кредитными рисками своих участников, должна принимать залоговое обеспечение с низким кредитным и рыночным риском и риском ликвидности. ИФР также должна установить и применять достаточно консервативные «стрижки» и лимиты концентрации.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. Как правило, ИФР должна ограничивать виды активов, которые она (как правило) принимает в качестве залогового обеспечения, активами с низким кредитным и рыночным риском и риском ликвидности.</p>	Не применимо	Положения данного принципа не применимы к Центральному депозитарию, поскольку схемы расчетов по ценным бумагам не предполагают прием какого-либо залогового обеспечения для управления кредитным риском.
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна установить пруденциальные методы оценки и разработать систему «стрижек», подлежащих регулярным тестам, с учетом стрессовых состояний рынка.</p>	Не применимо	

Принцип	Соответствие	Описание
Ключевое соображение 3. Для уменьшения потребности в проциклических корректировках, ИФР должна установить стабильные и консервативные «стрижки», откалиброванные так, чтобы включать в себя периоды стрессового состояния рынка, в той мере, в которой это разумно и целесообразно.	Не применимо	
Ключевое соображение 4. ИФР должна избегать концентрации определенных активов, если это может существенно снизить возможность их быстрой ликвидации без существенного неблагоприятного влияния на цену.	Не применимо	
Ключевое соображение 5. ИФР, принимающая трансграничное залоговое обеспечение, должна смягчать риски, связанные с его использованием, и обеспечивать возможность его своевременного использования.	Не применимо	
Ключевое соображение 6. ИФР должна использовать хорошо организованную и обладающую операционной гибкостью систему управления залоговым обеспечением.	Не применимо	
Принцип 6. Гарантийный депозит		
ЦКА должен покрывать свои кредитные риски, создаваемые его участниками, по всем продуктам с помощью эффективной системы гарантийных депозитов, учитывающей риски и регулярно пересматриваемой.		
Ключевое соображение 1. ЦКА должен иметь систему гарантийных депозитов, устанавливающую уровни гарантийных депозитов, сопоставимые с рисками и характерными особенностями каждого обслуживаемого им продукта, портфеля и рынка.	Не применимо	Положения данного принципа не применимы к Центральному депозитарию, поскольку Центральный депозитарий не осуществляет функции ЦКА, а также схемы расчетов по ценным бумагам не предполагают создания системы гарантийных депозитов.

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ЦКА должен иметь надежный источник своевременных данных о ценах, используемых в своей системе гарантийных депозитов. ЦКА также должен применять процедуры и надежную модель оценки для использования в обстоятельствах, когда данные о ценах ненадежны или недоступны.</p>	<p>Не применимо</p>	
<p>Ключевое соображение 3. ЦКА должен использовать модели первоначальной маржи и параметры, учитывающие риски, и разработать маржинальные требования, достаточные для покрытия своих потенциальных будущих рисков в отношении участников, в промежутке между последним внесением маржи и ликвидацией позиций после дефолта участника. Начальная маржа должна соответствовать установленному в каждом случае отдельно уровню доверительной вероятности не менее 99 процентов, в отношении предполагаемого распределения будущих рисков. Если ЦКА рассчитывает маржу на уровне портфеля, данное требование применяется к распределению будущих рисков по каждому портфелю. Если ЦКА рассчитывает маржу более детально, например, на уровне субпортфеля или продукта, требование по распределению будущих рисков должно соблюдаться соответственно. Модель должна (а) включать консервативную оценку временных горизонтов для эффективного хеджирования или ликвидации определенных типов продуктов, клиринг по которым</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>осуществляет ЦКА (в том числе, при стрессовых состояниях рынка), (b) включать соответствующий способ измерения кредитного риска, учитывающий факторы риска по каждому соответствующему продукту и влияние портфельных рисков на разные продукты, и (c) если это необходимо и целесообразно, ограничивать необходимость дестабилизирующих проциклических изменений.</p>		
<p>Ключевое соображение 4. ЦКА должен проводить оценку позиций участников на основе текущих рыночных цен и взимать вариационную маржу, по меньшей мере, ежедневно с целью ограничения нарастания существующих рисков. ЦКА должен иметь соответствующий орган, полномочия и операционные возможности для выставления участникам ежедневных требований о внесении дополнительной маржи или платежей как по графику, так и вне графика.</p>	<p>Не применимо</p>	
<p>Ключевое соображение 5. При расчете требований о внесении дополнительной маржи ЦКА вправе допускать взаимозачет и снижение требуемой маржи в отношении продуктов, клиринг которых производит он лично, а также в отношении продуктов, клиринг по которым производит он и другие ЦКА, если риск по одному продукту в значительной степени коррелирован с риском по другому продукту. Если два или несколько ЦКА уполномочены предлагать кросс-маржу (перекрестные</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>гарантийные депозиты), они должны обеспечивать соответствующие меры безопасности и гармонизированную общую систему управления рисками.</p>		
<p>Ключевое соображение 6. ЦКА должен анализировать и проводить мониторинг функционирования своей модели маржи и общего маржевого покрытия посредством проведения строгих ежедневных бэк-тестов, – и не реже одного раза в месяц, а при необходимости, более часто, – анализа чувствительности. ЦКА должен регулярно проводить оценку теоретических и эмпирических свойств модели маржи по всем продуктам, клиринг по которым он производит. При проведении анализа чувствительности покрытия модели ЦКА должен принимать во внимание широкий спектр параметров и допущений, отражать возможные рыночные условия, включая периоды наиболее высокой волатильности, имевшие место на рынках, которые он обслуживает, и экстремальные изменения в корреляции между ценами.</p>	<p>Не применимо</p>	
<p>Ключевое соображение 7. ЦКА должен регулярно проверять и оценивать свою систему гарантийных депозитов.</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 7. Риск ликвидности ИФР должна эффективно оценивать, проводить мониторинг и управлять своим риском ликвидности. ИФР должна поддерживать достаточные ликвидные ресурсы во всех необходимых валютах для осуществления расчетов по платежным обязательствам день в день и, при необходимости, в течение одного дня или нескольких дней, с высокой степенью надежности, в соответствии с широким спектром потенциально стрессовых сценариев, включающих, но не ограничивающихся невыполнением обязательств участником и его аффилированными лицами, способным привести к наибольшим совокупным обязательствам ИФР по ликвидности в экстремальных, но вероятных рыночных условиях.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь надежную систему управления риском ликвидности, создаваемым ее участниками, расчетными банками, агентами ностро, банками-депозитариями, провайдерами ликвидности и другими организациями.</p>	<p>Частично соблюдается</p>	<p>Положения данного принципа не вполне применимы к Центральному депозитарию, поскольку Центральный депозитарий не осуществляет функции ЦКА и отсутствует необходимость поддерживать ликвидные ресурсы с учетом специфики расчетов по ценным бумагам.</p>
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна иметь эффективные операционные и аналитические инструменты для выявления, измерения и мониторинга своих расчетов и движения средств на непрерывной и своевременной основе, включая использование ликвидности в течение операционного дня.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В настоящее время Центральный депозитарий является единственной организацией, осуществляющей депозитарную деятельность и деятельность по ведению системы реестров держателей ценных бумаг на территории Республики Казахстан. В связи с интеграцией двух учетных систем – регистраторской и депозитарной с 01 января 2019 года регистрация операций и сделок между субсчетами в номинальном держании и лицевыми счетами в системе реестров держателей ценных бумаг осуществляется напрямую, без необходимости перевода ценных бумаг в номинальное держание или в систему реестров держателей ценных бумаг.</p> <p>Центральный депозитарий использует систему валовых расчетов, которая не позволяет оптимизировать расчетную ликвидность. Кроме того, отсутствие кредитных линий, кредитование акций и несостоятельность механизмов управления способствуют некоторой степени подверженности риску ликвидности, в частности, для внебиржевых расчетов. Тем не менее, рынки репо и обратного репо выглядят активными. Имеется модель расчетов с полным предварительным финансированием для биржевых сделок, которая практически исключает неудачи на рынке. При этом KASE взимает штрафы за невыполнение сделок. Все ценные бумаги, подлежащие расчету в Центральном депозитарии, дематериализованы, а процесс регистрации в SWIFT занимает в среднем менее двух часов.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 3. Платежная система или СРЦБ, в том числе использующая механизм отсроченных нетто-расчетов, должна поддерживать достаточно ликвидных ресурсов во всех соответствующих валютах для проведения расчетов по платежным обязательствам день в день, и, при необходимости, в течение одного дня или нескольких дней, с высокой степенью уверенности, в соответствии с широким спектром потенциально стрессовых сценариев, которые должны включать, но не ограничиваться, невыполнением обязательств участником и его аффилированными лицами, способным создать наибольшее совокупное платежное обязательство в экстремальных, но вероятных рыночных условиях.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Цикл расчетов T+2 реализован для всех финансовых инструментов фондового рынка KASE, аукционов краткосрочных нот НБК и позволяет использовать маржу. Центральный депозитарий использует систему gross-расчетов наряду с системой нетто-расчетов, являясь расчетной организацией для KASE. С выполнением KASE функции ЦКА гарантируется исполнение обязательств перед каждым добросовестным участником, что избавляет участников торгов от необходимости оценивать кредитные риски всех контрагентов-участников торгов. Также снижены издержки для участников торгов за счет наличия единственного контрагента – ЦКА и неттинга взаимных требований и обязательств по сделкам с определенными финансовыми инструментами. Используются разные виды финансовых инструментов, принимаемые в качестве маржевого обеспечения. Повышена надежность биржевого рынка за счет гарантии исполнения заключенных сделок и увеличена ликвидность.</p> <p>В настоящее время цикл расчетов T+2 реализован для всех финансовых инструментов фондового рынка KASE, в которые входят акции, корпоративные облигации, государственные ценные бумаги, депозитарные расписки с расчетами в долларах США, еврооблигации с расчетами в долларах США, ценные бумаги инвестиционных фондов, международных облигаций Республики Казахстан, ценных бумаг международных финансовых организаций и допускает маржу. Это потенциально должно увеличить ликвидность на рынке.</p>
<p>Ключевое соображение 4. ЦКА должен поддерживать достаточно ликвидных ресурсов во всех соответствующих валютах для проведения расчетов по ценным бумагам, проводить требуемые платежи по вариационной марже и выполнять другие платежные обязательства своевременно и с высокой степенью уверенности в соответствии с широким спектром потенциально стрессовых сценариев, включающих, но не ограничивающихся невыполнением обязательств участником и его аффилированными лицами, способным создать наибольшее совокупное платежное</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>обязательство для ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Кроме того, ЦКА, ведущий деятельность с более сложным профилем риска или являющийся системно значимым в нескольких юрисдикциях, должен предусмотреть поддержание дополнительных ликвидных ресурсов, достаточных для покрытия широкого спектра потенциально стрессовых сценариев, включая, но не ограничиваясь дефолтом двух участников и их аффилированных лиц, способным создать наибольшее совокупное платежное обязательство для ЦКА в экстремальных, но вероятных рыночных условиях.</p>		
<p>Ключевое соображение 5. В целях выполнения требования к минимальным ликвидным ресурсам, квалификационные ликвидные ресурсы ИФР в каждой валюте включают в себя денежные средства в центральном банке-эмитенте и в кредитоспособных коммерческих банках, выделенные кредитные линии, договоры о свопах в иностранной валюте и подтвержденные репо, легко реализуемое на рынке залоговое обеспечение, находящееся на ответственном хранении, а также инвестиции с возможностью немедленного использования и конвертируемые в денежные средства с предварительно установленными и высоко надежными механизмами финансирования даже в экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Если ИФР на регулярной основе имеет доступ к кредиту в центральном банке-эмитенте,</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>ИФР вправе рассматривать данный доступ в качестве минимального требования при условии наличия залогового обеспечения, подходящего для залога в соответствующий центральный банк (или других соответствующих видов сделок с ним). Все перечисленные ресурсы должны быть с возможностью немедленного использования.</p>		
<p>Ключевое соображение 6. ИФР вправе дополнять квалификационные ликвидные ресурсы другими видами ликвидных ресурсов. В этом случае указанные ликвидные ресурсы должны быть в форме активов, легко реализуемых или приемлемых в качестве залогового обеспечения кредитной линии, свопа или обратной покупки в случае дефолта, даже если это не может быть надежным образом предварительно установлено или гарантировано в экстремальных рыночных условиях. Даже если ИФР не имеет на регулярной основе доступа к кредиту в центральном банке-эмитенте, она все же должна учитывать, какое залоговое обеспечение обычно принимается соответствующим центральным банком, так как эти активы могут с большей вероятностью оказаться ликвидными в обстоятельствах стресса. ИФР не должна рассматривать возможность получения экстренного кредита в центральном банке как часть своего плана ликвидности.</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 7. ИФР должна приобрести высокую степень уверенности благодаря строгой комплексной проверке в том, что каждый провайдер минимальных требуемых квалификационных ликвидных ресурсов, независимо от того, является ли он участником ИФР или третьей стороной, обладает достаточной информацией для понимания и управления своим сопутствующим риском ликвидности, а также что он имеет возможность выполнять требования, предусмотренные его обязательствами. Если это необходимо для оценки надежности работы провайдера ликвидности в отношении определенной валюты, может учитываться потенциальный доступ провайдера ликвидности к кредиту в центральном банке-эмитенте. ИФР должна регулярно тестировать собственные процедуры доступности своих ликвидных ресурсов, находящихся у провайдера ликвидности.</p>	<p>Не применимо</p>	
<p>Ключевое соображение 8. ИФР, имеющая доступ к счетам в центральном банке, платежным услугам или услугам, связанным с ценными бумагами, должна пользоваться этими услугами, если это целесообразно, для расширения возможностей управления риском ликвидности.</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 9: ИФР должна определить объем и регулярно тестировать достаточность своих ликвидных ресурсов посредством строгого стресс-тестирования. ИФР должна иметь четкие процедуры отчетности о результатах стресс-тестов перед соответствующими органами ИФР, принимающими решения, и использовать результаты для оценки адекватности и корректировки своей системы управления риском ликвидности. При проведении стресс-тестирования ИФР должна учитывать широкий спектр стресс-сценариев. Сценарии должны предусматривать соответствующие пиковые значения исторической волатильности цен, изменения других рыночных факторов, таких как ценовые детерминанты и кривые доходов, множественные случаи дефолта за различные периоды времени, одновременное давление на рынках финансирования и активов, а также ряд перспективных стресс-сценариев в разнообразных экстремальных, но вероятных рыночных условиях. Сценарии должны учитывать структуру и деятельность ИФР, включать все организации, представляющие существенный риск ликвидности для ИФР (например, расчетные банки, агенты ностро, банки-депозитарии, провайдеры ликвидности и связанные ИФР), и, в соответствующих случаях, покрывать многодневный период. Во всех случаях ИФР должна документально обосновать рациональную основу и иметь</p>	<p>Не применимо</p>	

Принцип	Соответствие	Описание
соответствующие механизмы управления, регулирующие величину и вид поддерживаемых ею общих ликвидных ресурсов.		
Ключевое замечание 10: ИФР должна иметь четкие правила и процедуры, позволяющие ИФР своевременно проводить расчеты по платежным обязательствам в день заключения сделки и, в соответствующих случаях, в течение одного дня или нескольких дней в случае индивидуального или коллективного дефолта участников. Данные правила и процедуры должны регулировать непредусмотренный и потенциальный непокрытый дефицит ликвидности и должны иметь своей целью предотвращение закрытия позиции, отзыва или задержки расчета по платежным обязательствам в день сделки. Данные правила и процедуры также должны определять процесс пополнения ИФР ресурсов ликвидности, задействованных ею в ходе стрессового события, таким образом, чтобы ИФР могла продолжать работу надежным и эффективным образом.	Не применимо	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 8. Завершенность расчетов ИФР должна обеспечивать четкий и определенный окончательный расчет, по меньшей мере, до завершения даты валютирования. Если это необходимо или целесообразно, ИФР должна обеспечивать окончательный расчет в течение операционного дня или в режиме реального времени.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. Правила и процедуры ИФР должны четко определять момент, когда расчет становится окончательным.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Расчет по сделке регламентирован Сводом правил и считается окончательным:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) в момент получения Центральным депозитарием подтверждения о зачислении денег на счет отправителя финансовых инструментов (при регистрации сделки, требующей осуществления денежных расчетов, и если банковский счет отправителя финансовых инструментов открыт в платежной системе); 2) в момент зачисления Центральным депозитарием денег на счет отправителя финансовых инструментов (при регистрации сделки, требующей осуществления денежных расчетов, и если банковский счет отправителя финансовых инструментов открыт в Центральном депозитарии); 3) в момент зачисления Центральным депозитарием финансовых инструментов на счет их получателя (при регистрации сделки, не требующей осуществления денежных расчетов, и если счет получателя финансовых инструментов открыт в Центральном депозитарии); 4) в момент получения Центральным депозитарием от иностранного или международного депозитария документа, подтверждающего зачисление финансовых инструментов на счет их получателя (при регистрации сделки по счету Центрального депозитария в иностранном или международном депозитарии); 5) в момент получения Центральным депозитарием от иностранного или международного депозитария документа, подтверждающего списание финансовых инструментов со счета Центрального депозитария (при регистрации сделки, по счету Центрального депозитария в иностранном или международном депозитарии); 6) в момент зачисления Центральным депозитарием активов на счета участников клиринга на основании приказа от организатора торгов приказа на регистрацию нетто-операции. <p>Перевод заблокированных на счете отправителя финансовых инструментов по сделкам, требующим перевода денег, осуществляется Центральным депозитарием только в случае, если МСПД, иностранный или международный депозитарий, или платежная система Центрального депозитария подтвердили перевод денег</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна производить окончательный расчет не позднее завершения даты валютирования, желательно в течение операционного дня или в режиме реального времени, для снижения расчетного риска. Система крупных платежей или СРЦБ должна рассмотреть возможность использования системы валовых расчетов в режиме реального времени или мультипакетной обработки в течение расчетного дня.</p>	Соблюдается	<p>отправителю. В противном случае финансовые инструменты разблокируются на счете их отправителя.</p> <p>Центральный депозитарий обеспечивает расчет в течение даты валютирования и практически в режиме реального времени.</p>
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна четко определить момент, после которого неурегулированные платежи, распоряжения о переводе и другие обязательства не могут быть отозваны участником.</p>	Соблюдается	<p>Неурегулированные платежи, распоряжения о переводе и другие обязательства не могут быть отозваны участником после выполнения действий согласно приказу или иному документу, являющемуся основанием для регистрации сделки (операции, события) в момент отправления (вручения) лицу, подавшему приказ (документ), отчетного документа, подтверждающего исполнение этого приказа (документа).</p>
<p>Принцип 9. Денежные расчеты ИФР должна осуществлять денежные расчеты в средствах центрального банка в тех случаях, когда это целесообразно и возможно. Если средства центрального банка не используются, ИФР должна минимизировать и строго контролировать кредитные риски и риски ликвидности, возникающие вследствие использования средств коммерческих банков.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна проводить денежные расчеты в средствах центрального банка, в тех случаях, когда это целесообразно и возможно, во избежание кредитного риска и риска ликвидности.</p>	Соблюдается	<p>Денежные расчеты в тенге осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Национальном Банке, или денег клиентов, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счете в Национальном Банке.</p> <p>Денежные расчеты в иностранной валюте осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счетах в международном депозитарии и банке с высоким кредитным рейтингом.</p> <p>Центральный депозитарий разработал и утвердил внутренний документ, регламентирующий порядок выбора кастодианов и банков для осуществления</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. Если средства центрального банка не используются, ИФР должна проводить свои денежные расчеты с использованием безрисковых активов или расчетных активов с низким кредитным риском и риском ликвидности.</p>	Соблюдается	<p>расчетов, и устанавливающий требования к ним.</p> <p>Денежные расчеты в тенге осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Национальном Банке, или денег клиентов, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счете в Национальном Банке.</p> <p>Денежные расчеты в иностранной валюте осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счетах в международном депозитарии и банке с высоким кредитным рейтингом.</p> <p>Центральный депозитарий не использует собственные средства при расчете сделок. В настоящее время большая часть денежных расчетов на организованном рынке проводится через расчетный счет ЦКА, каким является KASE.</p>
<p>Ключевое соображение 3. Если ИФР производит расчеты в средствах коммерческого банка, она обязана проводить мониторинг, управлять и ограничивать свой кредитный риск и риск ликвидности, создаваемый коммерческими расчетными банками. В частности, ИФР должна установить и проводить мониторинг соблюдения применяемых к расчетным банкам строгих критериев, относящихся, помимо прочего, к порядку регулирования и надзора за их деятельностью, кредитоспособности, капитализации, доступу к ликвидности и операционной надежности. ИФР также должна проводить мониторинг и управлять концентрацией кредитного риска и риска ликвидности, создаваемых коммерческими расчетными банками.</p>	Соблюдается	<p>Денежные расчеты в тенге осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Национальном Банке, или денег клиентов, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счете в Национальном Банке.</p> <p>Денежные расчеты в иностранной валюте осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счетах в международном депозитарии и банке с высоким кредитным рейтингом.</p> <p>Центральный депозитарий разработал и утвердил внутренний документ, регламентирующий порядок выбора кастодианов и банков для осуществления расчетов, и устанавливающий требования к ним.</p> <p>Все контрагенты Центрального депозитария, через которые осуществляются платежи и расчеты по сделкам, являются объектами регулирования и надзора уполномоченных органов, и имеют достаточно высокий кредитный рейтинг.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 4. Если ИФР проводит денежные расчеты по собственным книгам, она должна минимизировать и строго контролировать свой кредитный риск и риск ликвидности.</p>	Не применимо	<p>Нормативная правовая база переводов денег в национальной валюте, в том числе окончательность перевода денег, регулируется законодательством Республики Казахстан по платежам и переводам денег, а именно: законом Республики Казахстан "О платежах и платежных системах", Правилами осуществления безналичных платежей и (или) переводов денег на территории Республики Казахстан.</p> <p>Центральный депозитарий не использует собственные средства при расчете сделок. В настоящее время большая часть денежных расчетов на организованном рынке проводится через расчетный счет ЦКА, каким является KASE.</p>
<p>Ключевое соображение 5. Юридические соглашения ИФР с расчетными банками должны четко указывать, когда именно при проведении переводов по книгам отдельных расчетных банков перевод становится окончательным, что полученные средства подлежат перечислению в максимально короткий срок, по меньшей мере, до окончания дня, а в идеале – в течение операционного дня, чтобы обеспечить ИФР и ее участникам возможность управлять кредитным риском и риском ликвидности.</p>	Соблюдается	<p>Нормативная правовая база переводов денег в национальной валюте, в том числе окончательность перевода денег, регулируется законодательством Республики Казахстан по платежам и переводам денег, а именно: законом Республики Казахстан "О платежах и платежных системах", Правилами осуществления безналичных платежей и (или) переводов денег на территории Республики Казахстан.</p>
<p>Принцип 10. Фактическая поставка ИФР должна четко определять свои обязательства в отношении поставки реальных инструментов или товаров, а также выявлять, проводить мониторинг и управлять рисками, связанными с фактической поставкой.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. Правила ИФР должны четко определять ее обязательства в отношении поставки физических инструментов и товаров.</p>	Не применимо	<p>Положения данного принципа не применимы к Центральному депозитарию, поскольку Центральный депозитарий не осуществляет физическую поставку инструментов и товаров (все финансовые инструменты, находящиеся в номинальном держании Центрального депозитария, дематериализованы).</p>
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять рисками и издержками, связанными с хранением и фактической поставкой физических</p>	Не применимо	

Принцип	Соответствие	Описание
инструментов или товаров.		
<p>Принцип 11. Центральные депозитарии ценных бумаг</p>		
<p>ЦДЦБ должен иметь соответствующие правила и процедуры, способствующие обеспечению сохранности выпусков ценных бумаг, минимизации и управлению рисками, связанными с хранением и передачей ценных бумаг. ЦДЦБ должен учитывать ценные бумаги в имобилизированной или дематериализованной форме с целью их перевода в бездокументарной форме.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ЦДЦБ должен иметь надлежащие правила, процедуры и методы контроля, включая надежную практику бухгалтерского учета, для защиты прав эмитентов и владельцев ценных бумаг, предотвращения несанкционированного создания или исключения ценных бумаг, и периодически (по меньшей мере, ежедневно) проводить сверку обслуживаемых им ценных бумаг.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В целях защиты прав эмитентов и владельцев ценных бумаг, предотвращения несанкционированного создания или исключения ценных бумаг Центральным депозитарием внедрены и принимаются следующие, но не ограничиваясь ими, меры:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) отдельный учет финансовых инструментов на соответствующих счетах; 2) при осуществлении сделок (операций) с финансовыми инструментами использование процедур двойного ввода, подтверждения и последующего контроля; 3) меры обеспечения физической и информационной безопасности (идентификация клиента, авторизация пользователей, шифрование данных, резервирование данных и другие); 4) предоставление клиентам отчетности по сделкам (операциям) с финансовыми инструментами; 5) сверка данных системы учета с данными международных и иностранных депозитариев (не реже одного раза в месяц и после каждой сделки); 6) внутренний аудит системы учета Центрального депозитария; 7) комплаенс-контроль за соответствием деятельности Центрального депозитария нормам применимого законодательства Республики Казахстан, устава и внутренних документов Центрального депозитария, условиям договорных отношений; 8) операционный аудит (не реже одного раза в пять лет). <p>Кроме того, в целях защиты прав эмитентов и владельцев ценных бумаг, Центральный депозитарий ежегодно осуществляет страхование своей профессиональной ответственности. В 2019 году Центральный депозитарий осуществил страхование своих рисков (профессиональной ответственности) на сумму 500 млн тенге. Объектами страхования являются имущественные интересы Центрального депозитария, связанные с причинением им убытков третьим лицам в результате осуществления профессиональной деятельности, а также</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ЦДЦБ не должен допускать наличие овердрафта и дебетовых остатков на счетах ценных бумаг.</p>	Соблюдается	<p>имущественные интересы Центрального депозитария, связанные с нанесением ему ущерба в результате наступления страховых случаев (умышленные действия работников страхователя или третьих лиц, финансовые и компьютерные преступления и прочие страховые случаи).</p> <p>Выдавая своим клиентам различные отчетные документы, в том числе составляемые или по каждому отдельному приказу, или на дату (на момент времени), или за период, выдаваемые в разовом характере или периодически на основании отдельных приказов, или без необходимости подачи отдельных приказов, Центральный депозитарий не допускает наличие овердрафта.</p>
<p>Ключевое соображение 3. ЦДЦБ должен учитывать ценные бумаги в иммобилизованной или дематериализованной форме с целью их перевода в бездокументарной форме. В соответствующих случаях ЦДЦБ должен стимулировать иммобилизацию и дематериализацию ценных бумаг.</p>	Соблюдается	<p>Дематериализация финансовых инструментов, выпущенных в документарной форме, осуществляется Центральным депозитарием путем учета и удостоверения прав по указанным финансовым инструментам в своей системе учета номинального держания на лицевых счетах (субсчетах) клиентов Центрального депозитария. Центральный депозитарий осуществляет хранение дематериализованных финансовых инструментов в порядке, установленном законодательством Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг".</p>
<p>Ключевое соображение 4. ЦДЦБ должен защищать активы от депозитарного риска с помощью надлежащих правил и процедур, не противоречащих его правовой основе.</p>	Соблюдается	<p>Центральный депозитарий оказывает услуги клиентам, клиринговым организациям, и (или) ЦКА организованного и (или) неорганизованного рынка ценных бумаг на условиях и в порядке, установленных Сводом правил.</p>
<p>Ключевое соображение 5. ЦДЦБ должен использовать надежную систему, обеспечивающую сегрегацию собственных активов ЦДЦБ и ценных бумаг его участников, а также сегрегацию в ценных бумагах участников. Если это не противоречит правовой основе, ЦДЦБ также должен операционным образом обеспечивать сегрегацию ценных бумаг, принадлежащих клиентам участника, в книгах участника и содействовать переводу активов клиентов.</p>	Соблюдается	<p>Учет финансовых инструментов клиентов Центрального депозитария осуществляется отдельно от финансовых инструментов, принадлежащих самому Центральному депозитарию, на забалансовых счетах.</p> <p>Субсчета, открываемые на лицевом счете депонента, предназначены для раздельного учета инструментов, принадлежащих депоненту и его клиентам:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) субсчет депонента – для учета инструментов, принадлежащих депоненту; 2) субсчет депонента для учета объявленных инструментов – для учета инструментов, выпущенных депонентом, но не размещенных им; 3) субсчет депонента для учета выкупленных инструментов – для учета инструментов, выпущенных депонентом и выкупленных им на вторичном финансовом рынке; 4) субсчет держателя – для учета инструментов, принадлежащих клиенту

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 6. ЦДЦБ должен выявлять, измерять, проводить мониторинг и управлять рисками, создаваемыми другими видами осуществляемой им деятельности. Для исследования этих рисков возможно использование дополнительных инструментов.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>депонента;</p> <p>5) субсчет номинального держателя – для учета инструментов, находящихся в номинальном держании у депонента или у клиента депонента;</p> <p>6) субсчет номинального держателя для агрегированного учета инструментов – для учета инструментов, находящихся в номинальном держании у депонента и принадлежащих клиентам депонента, на имена которых открыты субсчета держателей на лицевом счете депонента;</p> <p>7) субсчет эмитента для учета объявленных инструментов – для учета инструментов, выпущенных клиентом депонента, но не размещенных им;</p> <p>8) субсчет эмитента для учета выкупленных инструментов – для учета инструментов, выпущенных клиентом депонента и выкупленных им на вторичном финансовом рынке.</p> <p>Деятельность по управлению рисками Центрального депозитария регламентирована Правилами формирования системы управления рисками и внутреннего контроля для центрального депозитария, утвержденными постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 декабря 2018 года № 318, а также внутренними документами Центрального депозитария, такими как Политика управления рисками, утвержденная решением Совета директоров (протокол заочного голосования от 22 декабря 2020 года № 102 (з)) и Правила управления рисками, утвержденные решением Правления Центрального депозитария (протокол заседания от 31 марта 2011 года № 10). Данные документы регламентируют порядок выявления, оценки, измерения рисков, присущих деятельности Центрального депозитария, принятия мер реагирования и осуществления мониторинга, и контроля за ними.</p>
<p>Принцип 12. Расчетные системы обмена активами</p>		
<p>Если ИФР осуществляет расчеты по сделкам, включающие расчеты по двум взаимосвязанным обязательствам (например, транзакции с ценными бумагами или иностранной валютой), то она должна исключать риск потери основной суммы, производя окончательный расчет по одному обязательству после окончательного расчета по другому обязательству.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР, являющаяся расчетной системой обмена активами, должна исключать риск потери основной суммы, обеспечивая, чтобы окончательный расчет по одному обязательству осуществлялся, если</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В процессе регистрации сделки купли-продажи инструментов, связанной с переводом денег, Центральный депозитарий переводит продаваемые инструменты на раздел "расчеты", а также формирует и направляет на исполнение платежное поручение на перевод денег с банковского счета (позиции в МСПД) получателя инструментов на транзитный денежный счет Центрального</p>

Принцип	Соответствие	Описание
и только если проведен окончательный расчет по взаимосвязанному обязательству, независимо от того, производит ли ИФР расчеты на валовой основе или на нетто основе, а также от момента наступления завершенности.		<p>депозитария.</p> <p>В том случае если перевод денег согласно платежному поручению Центрального депозитария не был выполнен, Центральный депозитарий переводит (возвращает) инструменты с раздела "расчеты" на тот раздел лицевого счета или субсчета отправителя инструментов, с которого эти инструменты были списаны для зачисления на раздел "расчеты".</p> <p>В том случае если перевод денег согласно платежному поручению Центрального депозитария был выполнен, Центральный депозитарий:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) переводит продаваемые инструменты с раздела "расчеты" на тот раздел лицевого счета или субсчета получателя инструментов, который соответствует характеру регистрируемой сделки; 2) формирует и направляет на исполнение платежное поручение на перевод денег с транзитного денежного счета Центрального депозитария на банковский счет (позицию в МСПД) отправителя инструментов.

Принцип 13. Правила и процедуры, относящиеся к невыполнению обязательств участником

ИФР должна иметь эффективные и четко определенные правила и процедуры по управлению в случае невыполнения обязательств участником.

Правила и процедуры должны быть разработаны, чтобы гарантировать возможность совершения ИФР своевременных действий для снижения убытков и дефицита ликвидности и продолжения выполнения своих обязательств.

Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь правила и процедуры управления при дефолте участников, позволяющие ИФР продолжать выполнение своих обязательств в случае дефолта участника и регулировать пополнение ресурсов после дефолта.

Не применимо

Регистрация операций с ценными бумагами и деньгами осуществляется Центральным депозитарием при полном преддепонировании активов его клиентами. Центральный депозитарий отказывает в исполнении приказа на регистрацию сделки (операции, события) на неорганизованном рынке при отсутствии на лицевом счете/субсчете поставщика инструментов, указанных в данном приказе. При регистрации сделок на организованном рынке управлением дефолтов регулируется KASE. Условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности на финансовом рынке, в том числе причины отказа в исполнении сделок (операций, событий) отражены в Своде правил, который публикуется на интернет-сайте Центрального депозитария.

Ключевое соображение 2. ИФР должна быть хорошо подготовлена к применению правил и процедур управления при дефолте, включая соответствующие дискреционные процедуры, предусмотренные его правилами.

Не применимо

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна публично раскрывать ключевые аспекты своих правил и процедур управления при дефолте.</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 4. ИФР должна привлекать своих участников и другие заинтересованные стороны к тестированию и анализу процедур ИФР по управлению при дефолте, включая процедуры ликвидации. Тестирование и анализ должны проводиться не реже одного раза в год или после существенных изменений в правилах и процедурах для обеспечения их целесообразности и эффективности.</p>	Не применимо	<p>Регистрация операций с ценными бумагами и деньгами осуществляется Центральным депозитарием при полном преддепонировании активов его клиентами. Центральный депозитарий отказывает в исполнении приказа на регистрацию сделки (операции, события) на неорганизованном рынке при отсутствии на лицевом счете/субсчете поставщика инструментов, указанных в данном приказе.</p> <p>При регистрации сделок на организованном рынке управление дефолтов регулируется KASE. Условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности на финансовом рынке, в том числе причины отказа в исполнении сделок (операций, событий) отражены в Своде правил, который публикуется на интернет-сайте Центрального депозитария.</p> <p>В связи с вышеизложенным, а также учитывая отсутствие каких-либо нарушений и (или) проблем, связанных с процедурами прекращения деловых отношений и возврата активов клиентам, подлежащих ликвидации, Центральный депозитарий не проводил тестирование и анализ процедур по управлению при дефолте, включая процедуры ликвидации.</p>
<p>Принцип 14. Сегрегация и перемещаемость ЦКА должны иметь правила и процедуры, обеспечивающие сегрегацию и перемещаемость позиций клиентов участников и залогового обеспечения, предоставленного в ЦКА по данным позициям.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ЦКА должен, по меньшей мере, иметь механизмы сегрегации и перевода, эффективно защищающие позиции клиента участника и соответствующее залоговое обеспечение от дефолта и неплатежеспособности участника. Если помимо этого ЦКА предлагает защиту позиций и залогового обеспечения клиента от одновременного дефолта участника и другого клиента, ЦКА должен принять меры для обеспечения эффективности такой защиты.</p>	Не применимо	<p>Положения данного принципа не применимы к Центральному депозитарию, поскольку Центральный депозитарий не осуществляет функции ЦКА.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ЦКА должен использовать структуру счетов, позволяющую быстро выявлять позиции клиентов участника и сегрегировать соответствующее залоговое обеспечение. ЦКА должен поддерживать позиции и залоговое обеспечение клиентов на отдельных клиентских счетах или на клиентских счетах "омнибус".</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 3. ЦКА должен разработать механизмы перевода таким образом, чтобы с высокой долей вероятности позиции и залоговое обеспечение клиентов не исполняющего обязательства участника были переведены одному или нескольким другим участникам.</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 4. ЦКА должен публично раскрывать сведения о своих правилах, политиках и процедурах, касающихся сегрегации и возможности перевода позиции и залогового обеспечения клиентов участника. В частности, ЦКА должен раскрывать сведения о том, защищено ли залоговое обеспечение клиента на индивидуальной основе или на основе «омнибус». Кроме того, ЦКА должен публично раскрывать сведения об ограничениях, например, юридических или операционных ограничениях, способных повлиять на его способность сегрегировать или перевести позиции и залоговое обеспечение клиентов участника.</p>	Не применимо	

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 15. Общий коммерческий риск ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять общим коммерческим риском, а также располагать чистыми ликвидными активами, финансируемыми за счет собственного капитала, и достаточными для покрытия потенциальных общих коммерческих убытков, чтобы продолжать выполнение операций и оказание услуг как функционирующая структура в случае, если убытки станут реальными. Кроме того, чистые ликвидные активы всегда должны быть достаточными для восстановления или упорядоченного прекращения критически важных операций и услуг.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь надежные системы управления и контроля для выявления, мониторинга и управления общими коммерческими рисками, включая потери от неадекватной реализации бизнес- стратегии, отрицательного движения денежных средств или непредвиденные и чрезмерно высокие операционные расходы.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Центральный депозитарий осуществляет регулярный мониторинг своей финансовой устойчивости, включающий, в том числе, мониторинг показателей достаточности собственного капитала, коэффициентов ликвидности, уровня доходов и расходов. При этом оценка достаточности собственного капитала предусматривает оценку операционных, рыночных и кредитных рисков.</p>
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна иметь чистые ликвидные активы, финансируемые за счет собственного капитала (например, обыкновенные акции, открытые резервы и прочая нераспределенная прибыль), таким образом, чтобы она могла продолжать выполнение операций и оказание услуг как функционирующая структура в том случае, если она понесет общие коммерческие убытки. Величина чистых ликвидных активов, финансируемых за счет собственного капитала, которой должна располагать ИФР, определяется ее общим профилем риска и продолжительностью времени, необходимого для реализации мер по возобновлению деятельности или упорядоченному прекращению наиболее важных операций и услуг, если такие</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Ликвидные активы Центрального депозитария, предназначенные для покрытия рисков, в том числе общего коммерческого риска, представлены государственными ценными бумагами, выпущенными Министерством финансов и Национальным Банком, а также вкладами в Национальном Банке. В настоящее время уровень чистых ликвидных активов Центрального депозитария достаточен для покрытия расходов Центрального депозитария в течение более чем двух лет.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>меры принимаются.</p> <p>Ключевое соображение 3. ИФР должна утвердить жизнеспособный план восстановления или упорядоченной ликвидации и обладать достаточными чистыми ликвидными активами, финансируемыми за счет собственного капитала, для его реализации. Величина чистых ликвидных активов ИФР, финансируемых за счет собственного капитала, должна составлять не менее величины текущих операционных расходов за шесть месяцев. Данные активы являются дополнением к ресурсам, необходимым для покрытия невыполненных обязательств участников или других рисков, предусмотренных принципами управления финансовыми ресурсами. Тем не менее, капитал, соответствующий международным стандартам, основанным на рисках, может учитываться в соответствующих случаях, если это необходимо или целесообразно, во избежание дублирования требований о достаточности капитала.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В целях обеспечения непрерывности деятельности разработаны и утверждены Политика управления непрерывностью деятельности, планы обеспечения непрерывности деятельности и управления инцидентами. Кроме того, Центральный депозитарий осуществляет мониторинг и контроль показателей достаточности капитала и денежной ликвидности в целях обеспечения финансовой устойчивости.</p>
<p>Ключевое соображение 4. Активы, предназначенные для покрытия общего коммерческого риска, должны быть высококачественными и достаточно ликвидными для покрытия ИФР своих текущих и прогнозируемых операционных расходов в рамках различных сценариев, в том числе в условиях неблагоприятной ситуации на рынке.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Собственные активы Центрального депозитария инвестируются в государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан, Национального Банка и вклады в Национальном Банке. Данные активы являются наименее рискованными и наиболее ликвидными.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 5. ИФР должна иметь жизнеспособный план по привлечению дополнительного капитала в случае, если ее собственный капитал приблизится к установленному минимуму или станет ниже. План должен быть одобрен советом директоров и регулярно обновляться.</p>	Соблюдается	Центральный депозитарий осуществляет постоянный мониторинг достаточности собственного капитала. Внутренними документами Центрального депозитария определены показатели, ухудшение которых требует принятия мер реагирования, направленных на повышение финансовой устойчивости Центрального депозитария.
<p>Принцип 16. Депозитарный и инвестиционный риск ИФР должна защищать свои активы и активы своих участников и минимизировать риск потерь и несвоевременного доступа к ним. ИФР должна инвестировать в инструменты с минимальными кредитным и рыночным риском и риском ликвидности.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна хранить свои активы, включая активы, переданные ей участниками, в организациях, являющихся предметом надзора и регулирования и имеющих учетную практику, процедуры безопасного хранения и системы внутреннего контроля, обеспечивающие полную защиту активов.</p>	Соблюдается	<p>Центральный депозитарий открывает счета номинального держания в иностранных и международных депозитариях, и у кастодианов.</p> <p>Организации-резиденты Республики Казахстан, в которых Центральный депозитарий может открывать счета, являются объектом надзора и регулирования со стороны Национального Банка. При этом Национальным Банком установлены для данных организаций пруденциальные нормативы, требования к системам управления рисками и внутреннего контроля, а также иные обязательные требования.</p> <p>Вместе с тем Центральным депозитарием установлены требования к учетным организациям и обслуживающим банкам. Центральный депозитарий на постоянной основе осуществляет мониторинг соответствия учетных организаций и обслуживающих банков установленным требованиям.</p>
<p>Ключевое соображение 2. При необходимости ИФР должна иметь немедленный доступ к своим активам, а также активам, переданным ей участниками.</p>	Соблюдается	Центральный депозитарий и участники имеют доступ к своим активам в любое время в течение операционного дня Центрального депозитария, его учетных организаций и обслуживающих банков.
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна оценивать и понимать риски, связанные с ее банками-депозитариями, с учетом взаимосвязей с каждым из них.</p>	Соблюдается	<p>Денежные расчеты в тенге осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Национальном Банке, или денег клиентов, хранящихся в Центральном депозитарии, который, в свою очередь, хранит эти деньги на счете в Национальном Банке.</p> <p>Денежные расчеты в иностранной валюте осуществляются с использованием денег клиентов Центрального депозитария, хранящихся в Центральном депозитарии,</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 4. Инвестиционная стратегия ИФР должна согласовываться с общей стратегией управления рисками и в полной мере раскрываться ее участникам, а инвестиции должны быть обеспечены или состоять из требований к высоконадежным должникам. Инвестиции ИФР должны предоставлять возможность быстрой ликвидации с минимальной потерей (или без потери) в цене.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>который, в свою очередь, хранит эти деньги на счетах в международном депозитарии и банке с высоким кредитным рейтингом. Центральный депозитарий разработал и утвердил внутренний документ, регламентирующий порядок выбора кастодианов и банков для осуществления расчетов, и устанавливающий требования к ним.</p> <p>Политика инвестирования собственных активов утверждена Советом директоров и является общедоступной (опубликована на интернет-сайте Центрального депозитария). Названная политика предусматривает возможность инвестирования собственных активов Центрального депозитария в:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, за исключением ценных бумаг, выпущенных местными исполнительными органами Республики Казахстан; 2) государственные ценные бумаги местных исполнительных органов Республики Казахстан, имеющие на момент инвестирования кредитный рейтинг от одного из международных рейтинговых агентств (Standard & Poor's, Moody's Investors Service, Fitch ratings), минимальный уровень которого может быть не более чем на один нотч ниже актуального наименьшего суверенного кредитного рейтинга Республики Казахстан; 3) облигации международных финансовых организаций с кредитным рейтингом финансового инструмента или эмитента не ниже "BB+" по шкале Standard & Poor's или равнозначного рейтинга Fitch ratings или Moody's Investors Service; 4) агентские облигации с рейтингом финансового инструмента или эмитента не ниже "BB-" по шкале Standard & Poor's или равнозначного рейтинга Fitch ratings или Moody's Investors Service; 5) депозиты в Национальном Банке; 6) операции обратного репо с использованием услуг ЦКА с корзиной "Государственные ценные бумаги"; 7) операции обратного репо с использованием услуг ЦКА с корзиной "Облигации эмитента с долей государственного участия".

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 17. Операционный риск ИФР должна выявлять все возможные источники операционного риска, как внутренние, так и внешние, и ослаблять их влияние за счет использования надлежащих систем, политик, процедур и методов контроля. Системы должны обеспечивать высокую степень безопасности и операционной надежности и иметь достаточную наращиваемую пропускную способность. Управление непрерывностью деятельности должно быть направлено на своевременное восстановление операций и выполнение обязательств ИФР, в том числе в случае широкомасштабного или крупного нарушения в работе.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна создать надежную структуру управления операционным риском с использованием соответствующих систем, принципов, процедур и методов контроля с целью выявления, мониторинга и управления операционными рисками.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Процедуры управления операционными рисками разработаны в соответствии с требованиями Национального Банка, рекомендациями Базельского комитета по банковскому надзору и Принципами для ИФР, и регламентированы Политикой управления рисками, утвержденной решением Совета директоров (протокол заочного голосования 22 декабря 2020 года № 102 (з)), а также другими внутренними документами Центрального депозитария. Центральный депозитарий применяет следующие, но не ограничиваясь ими, инструменты управления операционными рисками:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) идентификация операционных рисков в новых и существующих услугах и бизнес-процессах; 2) самооценка рисков и контролей; 3) сбор и анализ статистики по операционным рискам; 4) количественная оценка операционных рисков, в том числе оценка капитала, необходимого на покрытие операционных рисков; 5) стресс-тестирование по операционным рискам; 6) формирование карт/матриц операционных рисков; 7) страхование операционных рисков.
<p>Ключевое соображение 2. Совет директоров ИФР должен четко определить роли и обязанности по адресации операционных рисков и утвердить систему управления операционным риском ИФР. Системы, операционные принципы, процедуры и методы контроля должны пересматриваться, проверяться и тестироваться периодически и после значительных изменений.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Роли и обязанности структурных подразделений и коллегиальных органов Центрального депозитария определены внутренними документами по вопросам управления рисками. Оценка эффективности системы управления рисками и внутреннего контроля осуществляется самостоятельно, а также в рамках проведения аудиторских проверок.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна иметь четко определенные цели в области операционной надежности и политики, разработанные для решения эти задач.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Для решения задач обеспечения операционной надежности Центральный депозитарий разработал и утвердил внутренние документы, регламентирующие процедуры управления операционными и иными рисками, возникающими в деятельности Центрального депозитария, обеспечения надежного функционирования аппаратно-программного оборудования, информационной, физической и пожарной безопасности, управления непрерывностью деятельности.</p>
<p>Ключевое соображение 4. ИФР должна обеспечить достаточную наращиваемую пропускную способность для обработки возросших объемов операций в период стресса и для обеспечения предоставления услуг на установленном уровне.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В целях оценки адекватности пропускной способности для обработки возросших объемов операций и обеспечения предоставления услуг на установленном уровне Центральный депозитарий ежеквартально осуществляет стресс-тестирование по операционному риску (сценарный анализ и тестирование систем Центрального депозитария путем подборки, комбинирования и моделирования стрессовых ситуаций).</p> <p>Центральный депозитарий осуществляет мониторинг внешних каналов связи информационных и коммуникационных систем. На основании мониторинга и контроля качества внешних каналов данных, в случае возникновения нештатных ситуаций, связанных с сетевыми и коммуникационными системами, Центральный депозитарий осуществляет действия, предусмотренные внутренними документами Центрального депозитария. Кроме того, Центральный депозитарий осуществляет мониторинг производительности серверного оборудования и баз данных с целью определения и отслеживания пропускной способности и производительности основного и резервного серверного оборудования.</p> <p>Адекватность мощностей и пропускной способности для обработки увеличенных стрессовых объемов операций определяется в информационной системе Центрального депозитария. Центральный депозитарий проводит тестирование внешних транспортных систем, автоматизированных информационных систем и серверного оборудования при стрессовых нагрузках.</p> <p>В случае выявления недостатка пропускной способности Центральный депозитарий принимает меры по ее повышению, оптимизации процессов и обеспечению своевременной обработки операций.</p> <p>Для мониторинга производительности серверов баз данных ежемесячно формируются отчеты о производительности сервера. В случае выявления недостатка производительности серверов Центральный депозитарий принимает меры по ее повышению.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 5. ИФР должна иметь политику комплексной физической и информационной безопасности, учитывающую все потенциальные уязвимые стороны и угрозы.</p>	Соблюдается	<p>Процедуры обеспечения физической и информационной безопасности Центрального депозитария разработаны в соответствии с законодательством Республики Казахстан и нормативными правовыми актами уполномоченного органа. Меры обеспечения физической и информационной безопасности регламентированы внутренними документами Центрального депозитария (см. также ответ к ключевому соображению 1 данного принципа).</p>
<p>Ключевое соображение 6. ИФР должна иметь план обеспечения непрерывности деятельности, учитывающий события, представляющие значительный риск нарушения в работе, включая события, способные вызвать широкомасштабное или глобальное нарушение. План должен предусматривать использование резервного объекта и обеспечивать, чтобы критические информационно-технологические (ИТ) системы возобновляли работу в течение двух часов после сбоя. План должен предусматривать для ИФР возможность завершения расчетов до окончания дня, когда произошло нарушение в работе, даже в экстремальных обстоятельствах. ИФР должна регулярно проводить тестирование этих механизмов.</p>	Соблюдается	<p>Планы управления непрерывностью деятельности Центрального депозитария разработаны в соответствии с международными стандартами и практикой и предусматривают порядок активации планов, порядок оповещения заинтересованных сторон, способы коммуникаций, порядок эвакуации и перемещения в резервный технический центр, порядок выявления статуса транзакций, процедуры восстановления и возврата к нормальному ходу деятельности, а также иные нормы. При этом планами предусмотрена необходимость восстановления критически важных видов деятельности (бизнес-процессов) в течение двух часов после нарушения нормального хода деятельности, а также необходимость завершения расчетов до окончания текущего рабочего дня. Для возможности бесперебойного оказания услуг Центральный депозитарий имеет полноценную резервную инфраструктуру – резервный технический центр, включающий дата-центр и резервный офис, укомплектованный необходимыми ресурсами и готовый к немедленной активации. Вся информация из систем основного офиса поступает в системы резервного технического центра в непрерывном режиме в течение всего операционного дня, а по завершении операционного дня резервируется. Резервный технический центр расположен на расстоянии около 35 километров от местонахождения офиса Центрального депозитария.</p>
<p>Ключевое соображение 7. ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять рисками, создаваемыми для ее операций ключевыми участниками, другими ИФР, провайдерами услуг и коммунальными службами. Кроме того, ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять рисками, создаваемыми ее операциями, для других ИФР.</p>	Соблюдается	<p>Процедуры мониторинга и управления операционными и иными рисками, возникающими в деятельности Центрального депозитария, регламентированы Правилами формирования системы управления рисками и внутреннего контроля для центрального депозитария, утвержденными постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 декабря 2018 года № 318, Политикой управления рисками, утвержденной Советом директоров Центрального депозитария (протокол заочного голосования от 22 декабря 2020 года № 102 (з)), Правилами управления рисками, утвержденными Правлением Центрального депозитария (протокол заседания от 31 марта 2011 года № 10).</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 18. Требования к доступу и участию ИФР должны иметь объективные, основанные на риске публично раскрываемые критерии участия, обеспечивающие справедливый и открытый доступ.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна предоставлять справедливый и открытый доступ к своим услугам, в том числе прямым и, в соответствующих случаях, непрямым участникам и другим ИФР на основе разумных связанных с риском требований к участию.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Категории лиц, которым Центральный депозитарий имеет право оказывать услуги на финансовом рынке, определяются законодательными актами Республики Казахстан или в соответствии с ними. Принадлежность клиента Центрального депозитария к той или иной категории лиц, которым Центральный депозитарий имеет право оказывать услуги на финансовом рынке, определяет виды счетов (лицевых счетов, субсчетов), которые Центральный депозитарий может открыть данному лицу, и виды услуг, которые Центральный депозитарий может оказывать данному лицу (с некоторыми допустимыми отклонениями, вытекающими из особенностей законодательства Республики Казахстан). С каждым своим клиентом Центральный депозитарий заключает только один договор, необходимый для получения этим клиентом любых услуг Центрального депозитария, которые могут быть оказаны этому клиенту согласно законодательству Республики Казахстан и Своду правил.</p>
<p>Ключевое соображение 2. Требования к участию в ИФР должны быть обоснованными в плане безопасности и эффективности ИФР и рынков, которые она обслуживает, учитывать и быть сопоставимыми с особыми рисками ИФР и раскрываться публично. При условии поддержания приемлемых стандартов контроля риска ИФР должна стремиться к установлению требований, предусматривающих наименьшие ограничения доступа, допустимые в существующих обстоятельствах.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Требования к установлению деловых отношений разработаны в соответствии с требованиями законодательства Республики Казахстан, являются стандартными для всех клиентов Центрального депозитария. Все внутренние документы Центрального депозитария, регламентирующие указанные требования, размещены на интернет-сайте Центрального депозитария.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна проводить мониторинг соблюдения своих требований к участию на непрерывной основе и иметь четко определенные и публично раскрываемые процедуры, обеспечивающие приостановление участия и упорядоченный выход участника, нарушившего требования к участию или прекратившего им соответствовать.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>В целях обеспечения определенных и прозрачных процедур для установления и прекращения деловых отношений разработаны внутренние документы, входящие в Свод правил, и устанавливающие требования к документам и процедурам для установления и прекращения деловых отношений с Центральным депозитарием. Данные документы размещаются на интернет-сайте Центрального депозитария. Центральный депозитарий осуществляет постоянный мониторинг за соблюдением участниками установленных требований.</p>
<p>Принцип 19. Многоуровневая структура участия ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять существенными рисками, создаваемыми для ИФР многоуровневой структурой участия.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна обеспечивать, чтобы ее правила, процедуры и соглашения позволяли собирать базовую информацию о непрямом участии с целью выявления, мониторинга и управления всеми существенными рисками, создаваемыми для ИФР многоуровневой структурой участия.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Лицо, намеренное заключить договор, должно подать Центральному депозитарию заявление. Подавая Центральному депозитарию заявление, заявитель тем самым подтверждает, что он:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) ознакомлен с условиями договора (то есть со Сводом правил), понимает их значение и безусловно согласен с ними; 2) безоговорочно принимает на себя установленные обязанности перед Центральным депозитарием; 3) безусловно согласен с правами клиента Центрального депозитария относительно Центрального депозитария, а также с ограничениями этих прав; 4) безусловно согласен с ответственностью Центрального депозитария, а также с ограничениями и исключениями этой ответственности.
<p>Формами заявления на установление, поддержание и прекращение деловых отношений с Центральным депозитарием предусмотрено предоставление клиентом базовой информации о непрямом участии. Центральный депозитарий может осуществлять сбор и анализ информации о непрямом участии в случаях, предусмотренных законодательством Республики Казахстан, и иных необходимых случаях.</p>		

Принцип	Соответствие	Описание
Ключевое соображение 2. ИФР должна выявлять существенную зависимость между прямыми и непрямыми участниками, способную повлиять на ИФР.	Соблюдается	Центральный депозитарий выявляет существенную зависимость между прямыми и непрямыми участниками в рамках идентификации клиентов, проводимой при установлении деловых отношений, в соответствии с положениями внутренних документов Центрального депозитария и требованиями законодательства Республики Казахстан.
Ключевое соображение 3. ИФР должна выявлять не прямых участников, проводящих значительные объемы транзакций, обрабатываемых ИФР, и не прямых участников, чьи объемы или количество транзакций являются крупными в сравнении с оборотом прямых участников, через которых они получают доступ к ИФР, в целях управления рисками, создаваемыми такими транзакциями.	Соблюдается	В рамках ПОД/ФТ Центральный депозитарий осуществляет мониторинг и изучение операций в случае осуществления клиентом систематически и (или) в значительных объемах необычных и (или) подозрительных операций.
Ключевое соображение 4. ИФР должна регулярно анализировать риски, создаваемые многоуровневой структурой участия, и, при необходимости, принимать меры по снижению рисков.	Соблюдается	В соответствии с программой управления рисками ОД/ФТ, указанной в правилах внутреннего контроля в целях противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, в Центральном депозитарии на ежегодной основе осуществляется оценка степени подверженности оказываемых им услуг рискам ОД/ФТ с учетом, как минимум, следующих специфических категорий рисков: риск по типу клиентов, страновой (географический) риск, риск услуги и (или) способа ее предоставления.
Принцип 20. Связи ИФР		
ИФР, устанавливающая связи с одной или несколькими ИФР, должна выявлять, проводить мониторинг и управлять рисками, создаваемыми этими связями.		
Ключевое соображение 1. До установления связи, а также постоянно после установления связи, ИФР должна выявлять, проводить мониторинг и управлять всеми потенциальными источниками риска, создаваемого связями. Механизмы связей должны быть организованы таким образом, чтобы каждая из ИФР могла	Соблюдается	Установление связей с другими ИФР осуществляется Центральным депозитарием на основании требований законодательства Республики Казахстан и (или) решений органов Центрального депозитария, принятых в установленном порядке в пределах их компетенции. При установлении связей, а также после установления связей, Центральный депозитарий осуществляет анализ и мониторинг присущих рисков и, при необходимости, принимает меры минимизации рисков. Для учета ценных бумаг клиентов установлены связи со следующими организациями (открыты счета номинального держания):

ОТЧЕТ О СОБЛЮДЕНИИ АО "ЦЕНТРАЛЬНЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ ЦЕННЫХ БУМАГ" ПРИНЦИПОВ
ДЛЯ ИНФРАСТРУКТУРЫ ФИНАНСОВОГО РЫНКА

Принцип	Соответствие	Описание
соблюдать другие принципы, изложенные в настоящем докладе.		<ol style="list-style-type: none"> 1) Clearstream Banking, A.G., Frankfurt; 2) Euroclear Bank S.A./N.V.; 3) ЗАО "Центральный депозитарий" (Кыргызская Республика); 4) небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" (Российская Федерация); 5) Республиканское унитарное предприятие "Республиканский центральный депозитарий ценных бумаг" (Республика Беларусь); 6) частная компания "Центральный Депозитарий Биржи Международного Финансового Центра Астана". <p>Для учета денег клиентов установлены связи со следующими организациями (открыты счета):</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Национальный Банк; 2) Clearstream Banking AG, Luxemburg; 3) Euroclear Bank N/A; 4) небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" (Российская Федерация); 5) Citibank, N.A. (Соединенные Штаты Америки); 6) Citibank, N.A. (Великобритания); 7) ПАО "Сбербанк" (Российская Федерация).
Ключевое замечание 2. Связь должна иметь во всех соответствующих юрисдикциях надежную правовую основу, поддерживающую ее структуру и обеспечивающую адекватную защиту связанных ИФР.	Соблюдается	Центральный депозитарий устанавливает связи в соответствии с законодательством Республики Казахстан. Взаимодействие с клиентами Центрального депозитария осуществляется на основании свода правил, согласно которому предусмотрена ответственность сторон за ненадлежащее исполнение обязательств.
Ключевое замечание 3. Связанные ЦДЦБ должны измерять, проводить мониторинг и управлять кредитным риском и риском ликвидности, создаваемыми друг для друга. Кредиты, предоставляемые друг другу ЦДЦБ, должны полностью обеспечиваться высококачественным залоговым обеспечением и подчиняться установленным лимитам.	Соблюдается	Регистрация операций с ценными бумагами и деньгами осуществляется Центральным депозитарием при полном преддепонировании активов его клиентами. Центральный депозитарий отказывает в исполнении приказа на регистрацию сделки (операции, события) на неорганизованном рынке при отсутствии на лицевом счете/субсчете поставщика инструментов, указанных в данном приказе. При регистрации сделок на организованном рынке управление дефолтов регулируется KASE. Условия и порядок осуществления Центральным депозитарием деятельности на финансовом рынке, в том числе причины отказа в исполнении сделок (операций, событий) отражены в своде правил, который

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 4. Предварительные передачи ценных бумаг между связанными ЦДЦБ должны быть запрещены или, по меньшей мере, обратная передача предварительно переданных ценных бумаг должна быть запрещена до того момента, когда первая передача становится окончательной.</p>	Соблюдается	<p>публикуется на интернет-сайте Центрального депозитария. Центральный депозитарий не предоставляет кредиты и не привлекает кредитные ресурсы для осуществления своей деятельности.</p> <p>Регистрация сделки или иной операции с финансовыми инструментами по счету Центрального депозитария в учетной организации осуществляется в соответствии с правилами учетной организации. Расчет по сделке регламентирован Сводом правил и считается окончательным в момент получения Центральным депозитарием от иностранного или международного депозитария документа, подтверждающего зачисление финансовых инструментов на счет их получателя (при регистрации сделки по счету Центрального депозитария в иностранном или международном депозитарии) или в момент получения Центральным депозитарием от иностранного или международного депозитария документа, подтверждающего списание финансовых инструментов со счета Центрального депозитария (при регистрации сделки, по счету Центрального депозитария в иностранном или международном депозитарии).</p>
<p>Ключевое соображение 5. ЦДЦБ-инвестор должен устанавливать связи с ЦДЦБ-эмитентом только в том случае, если такая договоренность предусматривает высокий уровень защиты прав участников ЦДЦБ-инвестора.</p>	Не применимо	Центральный депозитарий не инвестирует собственные активы в ценные бумаги, выпущенные другими центральными депозитариями.
<p>Ключевое соображение 6. ЦДЦБ-инвестор, привлекающий посредника для управления связью с ЦДЦБ-эмитентом, должен измерять, проводить мониторинг и управлять дополнительными рисками (включая депозитарный, кредитный, юридический и операционный риски), создаваемыми привлечением посредника.</p>	Не применимо	Центральный депозитарий не инвестирует собственные активы в ценные бумаги, выпущенные другими центральными депозитариями.

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 7. Перед установлением связи с другим ЦКА, ЦКА должен определить и обеспечить управление потенциальными эффектами вследствие дефолта, связанного ЦКА. Если связь установлена между тремя или более ЦКА, каждый ЦКА должен выявлять, оценивать и управлять рисками структуры коллективной связи.</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 8: Каждый ЦКА в структуре связи должен иметь возможность покрывать, по меньшей мере на ежедневной основе, свои текущие и потенциальные будущие риски, создаваемые связанным ЦКА и его участниками (если имеются) в полном объеме и с высокой степенью уверенности, не снижая при этом способности ЦКА исполнять свои обязательства перед собственными участниками в любой момент.</p>	Не применимо	
<p>Ключевое соображение 9: Торговый репозиторий должен внимательно оценивать дополнительные операционные риски, создаваемые его связями, для обеспечения возможности расширения и надежности ИТ-ресурсов и сопутствующих ресурсов.</p>	Соблюдается	<p>Для осуществления функций торгового репозитория установлены связи со следующими организациями:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) банки второго уровня; 2) организации, осуществляющие брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг; 3) организации, осуществляющие деятельность по управлению инвестиционным портфелем; 4) страховые (перестраховочные) организации. <p>Документы, подлежащие передаче в торговый репозиторий или выдаче из него, передаются только в электронном виде через систему "Личный кабинет Информированного лица". Для входа на портал Центрального депозитария применяются регистрационные свидетельства, выданные Национальным удостоверяющим центром Республики Казахстан.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
Принцип 21. Эффективность и результативность ИФР должна обеспечивать эффективность и результативность выполнения требований обслуживаемых ею участников и рынков.		
Ключевое соображение 1. ИФР должна иметь структуру, обеспечивающую удовлетворение потребностей ее участников и рынков, которые она обслуживает, в частности, в отношении выбора механизмов клиринга и расчетов, операционной структуры, спектра продуктов, по которым производится клиринг, расчеты или учет, а также использования технологий и процедур.	Соблюдается	Для обеспечения защиты интересов и удовлетворения потребностей участников структура Центрального депозитария предусматривает следующие органы: <ol style="list-style-type: none"> 1) Совет директоров, включающий семь членов, трое из которых являются независимыми директорами; 2) Комитет Совета директоров по стратегии, рискам, кадрам, вознаграждениям и социальным вопросам, состоящий из семи членов, трое из которых являются независимыми директорами Центрального депозитария и один из независимых директоров одновременно председателем данного Комитета. Вместе с тем в Центральном депозитарии функционирует Консультативный совет, являющийся коллегиальным консультативно-совещательным органом Центрального депозитария, представляющим интересы потребителей его услуг. Основной задачей Консультативного совета является подготовка и выдача коллективных рекомендаций (мнений) клиентов Центрального депозитария по вопросам, инициированным членами Консультативного совета в соответствии с его функциями, а также по вопросам, переданным (внесенным) на рассмотрение Консультативного совета Советом директоров или Правлением. Функциями Консультативного совета являются: <ol style="list-style-type: none"> 1) содействие в разработке свода правил; 2) предварительное рассмотрение изменений и дополнений в Свод правил, касающихся взаимодействия с клиентами при оказании Центральным депозитарием услуг, порядка регистрации сделок (операций) с финансовыми инструментами, а также тарифов и сборов Центрального депозитария; 3) предварительное рассмотрение вопросов, касающихся внедрения новых инициатив, продуктов и услуг Центрального депозитария; 4) рассмотрение иных вопросов, связанных с взаимоотношениями между клиентами и Центральным депозитарием. Центральный депозитарий определил в качестве основной цели своего развития на 2022–2024 годы формирование на базе Центрального депозитария гибкой экосистемы на фондовом рынке, обсуживающей обращение финансовых активов широкого спектра и оказывающей инвесторам и другим участникам рынка широкий перечень услуг. Цели Центрального депозитария отражаются и обновляются в стратегии развития,

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должны иметь четко определенные цели и задачи, поддающиеся оценке и достижимые, например, в том, что касается минимальных целевых уровней обслуживания, управления рисками и бизнес-приоритетов.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>планах работ и других документах Центрального депозитария. Для оценки степени реализации своих целей Центральный депозитарий осуществляет регулярное формирование соответствующих отчетов и информации.</p> <p>Стратегические цели и задачи Центрального депозитария, охватывающие все виды деятельности Центрального депозитария, определяются его стратегией развития, которая утверждается Советом директоров. Все цели измеримы и достижимы. Для измерения и оценки эффективности своей деятельности, а также качества обслуживания Центральный депозитарий разработал Порядок оценки качества предоставляемых АО "Центральный депозитарий ценных бумаг" услуг, в рамках которого проводится анкетирование клиентов.</p> <p>Для мониторинга поэтапной реализации указанной стратегии Центральный депозитарий разработал перечень ключевых показателей развития (КПР) и их целевые значения.</p> <p>Достижение целевых значений данных показателей индикативно отражает фактическую реализацию ключевых стратегических целей по основным направлениям развития Центрального депозитария.</p>
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должны иметь отработанные механизмы для регулярного анализа эффективности и результативности.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>С целью регулярного анализа эффективности и результативности Центральный депозитарий предоставляет Правлению и Совету директоров отчеты об исполнении плана основных работ и иных планов. Вместе с тем в АРРФР предоставляются отчеты об устранении замечаний, выявленных Национальным Банком по результатам проверок деятельности Центрального депозитария, информация о ходе исполнения работ, предусмотренных Дорожной картой по реализации пункта 4.2.4 Концепции развития финансовых технологий и инноваций на финансовом рынке Республики Казахстан в части развития инфраструктуры регистрации транзакций в Центральном депозитарии. Кроме того, Центральный депозитарий проводит мониторинг реализации проектов.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Принцип 22. Процедуры и стандарты передачи сообщений ИФР должна использовать, или, по меньшей мере, обеспечивать оперативную совместимость с международными процедурами и стандартами передачи сообщений для обеспечения эффективных платежей, клиринга, расчетов и учета.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна использовать или, по меньшей мере, обеспечивать оперативную совместимость с международными процедурами и стандартами передачи сообщений.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Для взаимодействия с международными и иностранными финансовыми институтами, а также с банками при осуществлении отдельных видов банковской деятельности используется система SWIFT. Для взаимодействия с депонентами при осуществлении депозитарной деятельности, а также для взаимодействия с брокерами при осуществлении отдельных видов банковских операций используется система доставки и получения информации, предоставляемая оператором платежной системы. Для взаимодействия с международными и иностранными депозитариями и депонентами – нерезидентами при осуществлении депозитарной деятельности используется международная система обмена стандартизированными документами и сообщениями SWIFT.</p>
<p>Принцип 23. Раскрытие правил, основных процедур и рыночных данных ИФР должны иметь четко сформулированные комплексные правила и процедуры и предоставлять достаточную информацию, позволяющую обеспечивать четкое понимание участниками рисков, сборов и других существенных издержек, связанных с их участием в ИФР. Все соответствующие правила и основные процедуры должны раскрываться публично.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ИФР должна принять четко сформулированные комплексные правила и процедуры, в полном объеме раскрываемые участникам. Соответствующие правила и основные процедуры должны раскрываться публично.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Правила и процедуры Центрального депозитария определены законодательством Республики Казахстан, нормативными правовыми актами уполномоченного органа, Сводом правил и другими внутренними документами Центрального депозитария. Названные документы являются общедоступными и размещаются на интернет-сайте Центрального депозитария и на других интернет ресурсах. Для обеспечения возможности понимания и оценки участниками рынка ценных бумаг рисков, связанных с Центральным депозитарием, на интернет-сайте Центрального депозитария публикуется информация о системе управления рисками, управления непрерывностью деятельности, годовые отчеты, финансовая отчетность и другая информация Центрального депозитария, которая дает представление о рисках, связанных с Центральным депозитарием. Кроме того, Центральный депозитарий предоставляет разъяснения своих правил и процедур по запросам участников.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 2. ИФР должна публично раскрывать четко сформулированные описания структуры и операций системы, а также права и обязанности ИФР и участников таким образом, чтобы участники могли оценить риски, связанные с участием в ИФР.</p>	Соблюдается	<p>Свод правил представляет собой комплект внутренних документов Центрального депозитария, разработанных в соответствии с законодательством Республики Казахстан и определяющих условия и порядок осуществления деятельности Центрального депозитария на финансовом рынке, и публикуется на интернет-сайте Центрального депозитария.</p> <p>Раскрытие информации Центрального депозитария осуществляется в случаях, предусмотренных действующим законодательством Республики Казахстан и Сводом правил.</p>
<p>Ключевое соображение 3. ИФР должна предоставлять всю необходимую и надлежащую документацию и проводить обучение, способствующие пониманию участниками правил и процедур ИФР, а также и рисков, связанных с их участием в ИФР.</p>	Соблюдается	<p>Правила и процедуры Центрального депозитария определены законодательством Республики Казахстан, нормативными правовыми актами уполномоченного органа, Сводом правил и другими внутренними документами Центрального депозитария. Названные документы являются общедоступными и размещаются на интернет-сайте Центрального депозитария и на других интернет ресурсах.</p> <p>Для обеспечения возможности понимания и оценки участниками рынка ценных бумаг рисков, связанных с Центральным депозитарием, на интернет-сайте Центрального депозитария публикуется информация о системе управления рисками, управления непрерывностью деятельности, годовые отчеты, финансовая отчетность и другая информация Центрального депозитария, которая дает представление о рисках, связанных с Центральным депозитарием.</p> <p>Кроме того, Центральный депозитарий предоставляет разъяснения своих правил и процедур по запросам участников, а также при необходимости может проводить обучение (семинары/тренинги), способствующее пониманию клиентами правил и процедур Центрального депозитария.</p>
<p>Ключевое соображение 4. ИФР должна публично раскрывать информацию о стоимости отдельных предлагаемых ею услуг и политике предоставления скидок. ИФР должна предоставлять подробное описание услуг, оказываемых на платной основе, в целях сравнения.</p>	Соблюдается	<p>Тарифы за услуги, оказываемые Центральным депозитарием, определяются в соответствии с внутренним документом Центрального депозитария "Положение о тарифах и сборах", входящим в состав Свода правил и содержащим условия и порядок начисления тарифов и сборов, взимаемых Центральным депозитарием, в том числе их ставки (размеры). Вместе с тем данный документ определяет порядок и сроки уплаты тарифов и сборов, а также ответственность за их неуплату (несвоевременную или неполную уплату). Положение о тарифах и сборах разработано в соответствии с законодательством Республики Казахстан и является общедоступным документом, который размещается на интернет-сайте Центрального депозитария.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 5. ИФР должна регулярно заполнять и публично раскрывать ответы по форме КПРС-МОКЦБ Структура раскрытия информации для ИФР. ИФР также должна, по меньшей мере, раскрывать базовые данные об объеме и количестве транзакций.</p>	Соблюдается	<p>Центральный депозитарий проводит самооценку один раз в два года и публикует ее результаты в виде отчета на интернет-сайте Центрального депозитария.</p> <p>Центральный депозитарий регулярно размещает на своем интернет-сайте сведения о финансовых инструментах (количество и объем), сделках, международных идентификаторах, присвоенных ценным бумагам и другим финансовым инструментам, облигациях и паях, а также информацию о стоимостях ценных бумаг для расчета общего тарифа, сделках биржевого репо, неисполненных приказах и иную статистическую информацию.</p>
<p>Принцип 24. Раскрытие рыночных данных торговыми репозиториями Торговый репозиторий должен обеспечивать своевременное и точное предоставление данных соответствующим компетентным органам и общественности в соответствии с их потребностями.</p>		
<p>Ключевое соображение 1. ТР должен обеспечивать предоставление данных в соответствии с требованиями регулирующих органов и отраслевыми требованиями в компетентные органы и публично. Данные должны быть всеобъемлющими и достаточно подробными в целях повышения прозрачности рынка и реализации других задач государственной политики.</p>	Соблюдается	<p>Во исполнение требования закона Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг" Центральный депозитарий предоставляет полный доступ к базам данных торгового репозитория уполномоченному органу. С этой целью Центральный депозитарий ежедневно в автоматическом режиме направляет Национальному Банку и АРРФР сведения о всех сделках с производными финансовыми инструментами.</p> <p>Информирующим лицам предоставлен доступ к данным системы реестров сделок в рамках представленных ими сведений посредством веб-приложения на интернет-сайте Центрального депозитария.</p> <p>На интернет-сайте Центрального депозитария размещены внутренние документы, регулирующие порядок ведения системы реестров сделок Центральным депозитарием.</p>
<p>Ключевое соображение 2. ТР должен иметь эффективные процессы и процедуры для предоставления данных в компетентные органы своевременным и надлежащим образом, способствуя выполнению ими обязанностей по регулированию и юридическим обязанностям.</p>	Соблюдается	<p>Отправка сведений реестра сделок с производными финансовыми инструментами Национальному Банку и АРРФР осуществляется в электронном виде в автоматическом режиме ежедневно.</p>

Принцип	Соответствие	Описание
<p>Ключевое соображение 3. ТР должен иметь надежные информационные системы, обеспечивающие предоставление точных текущих и исторических данных. Данные должны предоставляться своевременно и в формате, позволяющем легко провести их анализ.</p>	<p>Соблюдается</p>	<p>Центральный депозитарий направляет все сведения реестра сделок с производными финансовыми инструментами Национальному Банку и АРРФР посредством программы Финансовая автоматизированная система транспорта информации (ФАСТИ), которая обеспечивает защищенный электронный обмен информацией между клиентами системы и электронный документооборот.</p> <p>Центральный депозитарий разработал и передал Национальному Банку программу АРМ "НБРК ПФИ", позволяющей получать информацию о сделках, формат и содержание которой ранее согласованы с Национальным Банком.</p> <p>В Центральном депозитарии в качестве баз данных для хранения информации о сделках/операциях с финансовыми инструментами и переводов по банковским счетам используется система управления базами данных Oracle Enterprise Edition. Ключевые объекты в базах данных хранятся без сокращений и имеют аудиторский след в виде архивных записей. База данных работает в режиме горячего резервирования с двумя standby-сайтами, которые находятся в разных центрах обработки данных. В настоящее время подходит к завершающей стадии проект передачи всех данных из информационных систем Центрального депозитария в хранилище данных Национального Банка.</p>

V. ПЕРЕЧЕНЬ ОБЩЕДОСТУПНЫХ ИСТОЧНИКОВ

1. Интернет-сайт Центрального депозитария (www.kacd.kz).
2. Интернет-сайт Национального Банка (www.nationalbank.kz).
3. Интернет-сайт АРРФР (<https://www.gov.kz/memleket/entities/ardfm?lang=ru>).
4. Интернет-сайт Министерства финансов Республики Казахстан (<https://www.gov.kz/memleket/entities/minfin?lang=ru>).
5. Интернет-сайт KASE (www.kase.kz).
6. Интернет-сайт ОЮЛ "Ассоциация финансистов Казахстана" (www.afk.kz).
7. Интернет-сайт Депозитария финансовой отчетности (www.dfo.kz).