

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

---

**У т в е р ж д е н о**

решением Правлением  
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания  
от 15 мая 2020 года № 64)

**Введено в действие**

с 18 мая 2020 года

## ПОЛОЖЕНИЕ

### о Комитете по урегулированию дефолтов

*(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2020 года)*

---

---

г. Алматы

2020

## **ЛИСТ ПОПРАВК**

**1. Изменения № 1:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 25 декабря 2020 года № 167);
- введены в действие с 28 декабря 2020 года.

**2. Изменения и дополнения № 2:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 19 марта 2021 года № 28);
- введены в действие с 25 марта 2021 года.

Настоящее Положение определяет порядок формирования, работы и функции Комитета по урегулированию дефолтов (далее – Комитет) АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), состав, права, ответственность членов Комитета и регламент деятельности Комитета *(Преамбула изменена решением Правления Биржи от 25 декабря 2020 года)*.

#### **Статья 1. Общие положения**

1. Комитет является постоянно действующим органом при Правлении Биржи, создаваемый приказом Председателя Правления Биржи, задачей которого является определение условий заключения сделок, направленных на урегулирование дефолтов на рынках, в которых Биржа исполняет функции центрального контрагента, сделок, направленных на привлечение ликвидности в случае возникновения дефицита на корреспондентских счетах Биржи *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 25 декабря 2020 года и от 19 марта 2021 года)*.
2. В своей деятельности Комитет руководствуется законодательством Республики Казахстан, настоящим Положением, внутренними нормативными документами Биржи.
3. Комитет подотчетен Правлению Биржи и действует в рамках полномочий, предоставленных ему Правлением Биржи в соответствии с настоящим Положением.
4. Дополнительная оплата членства в Комитете не устанавливается.

#### **Статья 2. Состав Комитета**

1. В состав Комитета входят:
  - 1) член Правления Биржи, курирующий подразделение по управлению рисками;
  - 2) член Правления Биржи, курирующий подразделение по работе с эмитентами и инвесторами;
  - 3) член Правления Биржи, курирующий подразделение клиринга;
  - 4) руководитель подразделения клиринга;
  - 5) руководитель подразделения торгов;
  - 6) руководитель казначейства финансово-административного подразделения.

*(Данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 25 декабря 2020 года и от 19 марта 2021 года)*

- 1.1. Председателем Комитета назначается член Правления Биржи, курирующий подразделение по управлению рисками *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 19 марта 2021 года)*.
2. Председатель Комитета осуществляет руководство деятельностью Комитета и осуществляет следующие функции:
  - 1) организует работу Комитета;
  - 2) созывает заседания Комитета и председательствует на них;
  - 3) утверждает повестку дня заседания Комитета;
  - 4) определяет форму проведения заседания Комитета;
  - 5) организует обсуждение вопросов на заседаниях Комитета, а также заслушивает мнения лиц, приглашенных к участию в заседании;

- 6) распределяет обязанности между членами Комитета, дает им и секретарю Комитета поручения, связанные с изучением и подготовкой вопросов для рассмотрения на заседании Комитета;
  - 7) контролирует исполнение решений Комитета.
3. Функции по организационному и информационному обеспечению работы Комитета осуществляет секретарь Комитета. Секретарь Комитета назначается из числа работников Финансово-административного департамента приказом Председателя Правления Биржи.
4. Секретарь Комитета обеспечивает:
- 1) подготовку и проведение заседаний Комитета;
  - 2) сбор и систематизацию материалов к заседаниям;
  - 3) формирование повестки дня заседания Комитета или заочного голосования членов Комитета;
  - 4) своевременное направление членам Комитета и приглашенным лицам уведомлений о проведении заседаний Комитета, повесток дня заседаний, материалов по вопросам повестки дня;
  - 5) протоколирование заседаний, а также последующее хранение протоколов (решений) заседаний Комитета;
  - 6) по мере необходимости выдачу выписок из протоколов (решений) Комитета;
  - 7) исполнение иных функций по поручению Председателя или иных членов Комитета.
5. Приказом Председателя Правления Биржи назначается персональный состав Комитета, а также лица, их замещающие, за исключением замещения членов Комитета, указанных в подпунктах 2) и 3) пункта 1 настоящей статьи *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 19 марта 2021 года)*.

### **Статья 3. Функции Комитета**

Основными функциями Комитета являются:

- 1) определение и принятие решений об условиях заключения сделок, направленных на урегулирование дефолтов;
- 2) определение и принятие решений об условиях заключения сделок, направленных на привлечение ликвидности в случае возникновения дефицита на корреспондентских счетах Биржи.

*(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 25 декабря 2020 года)*

### **Статья 4. Порядок работы Комитета**

1. Заседания Комитета проводятся в очной или заочной форме по решению Председателя Комитета.
2. В случае проведения заседания в заочной форме каждый член Комитета подписывает бюллетень с результатами голосования и отражением особого мнения (при наличии). Секретарь на основании бюллетеней голосования готовит протокол.
3. Заседание Комитета может быть созвано по инициативе Председателя Комитета или по инициативе:
  - 1) любого члена Комитета;

- 2) члена Правления;
- 3) работника подразделения, ответственного за управление ликвидностью центрального контрагента (далее – ответственное подразделение).

Заседание Комитета проводится с обязательным приглашением лица, инициировавшего созыв Комитета.

4. При осуществлении деятельности Комитета основным средством дистанционного общения между членами Комитета и лицами, уполномоченными замещать членов Комитета в случае их отсутствия и/или возникновения конфликта интересов, является электронная почта или иные средства связи, в том числе и средства электронного обмена сообщениями.
5. Повестка дня заседания Комитета формируется секретарем Комитета на основе представленных материалов и утверждается Председателем Комитета.
6. Уведомление о проведении/созыве заседания Комитета с указанием времени и места проведения, с приложением утвержденной повестки дня и необходимых материалов по вопросам повестки дня направляется секретарем Комитета членам Комитета по электронной почте или иным средствам связи до времени заседания Комитета.
7. По предложению члена (членов) Комитета Комитет вправе дополнительно рассмотреть на заседании вопросы, не включенные в повестку дня, при условии согласия большинства участвующих в заседании членов Комитета и при наличии всех необходимых материалов по данным вопросам.
8. Заседание Комитета является правомочным (имеет кворум), если в нем принимает участие не менее половины членов Комитета.
9. Решение Комитета принимается большинством голосов присутствующих на заседании членов Комитета. Каждый член Комитета имеет один голос. При равенстве голосов решающим является голос Председателя Комитета.
10. Передача права голоса членом Комитета другому члену Комитета или работнику запрещается.
11. Заседание Комитета открывает Председатель Комитета в соответствии с утвержденной повесткой дня.
12. Для участия в заседании Комитета могут быть привлечены иные, помимо членов Комитета, лица без права участия в голосовании.

#### **Статья 5. Подготовка и предоставление материалов членам Комитета**

1. Материалы по каждому вопросу повестки дня должны содержать следующее:
  - 1) предложения ответственного подразделения об имеющихся условиях заключения сделок;
  - 2) необходимую информацию о текущих обязательствах и требованиях по финансовым инструментам на рассматриваемых торгово-клиринговых счетах;
  - 3) другие необходимые материалы, содержащие сведения, указанные в главе 4 Порядка урегулирования дефолтов на фондовом рынке.
2. При вынесении на рассмотрение Комитета вопроса о заключении сделок, направленных на привлечение ликвидности для исполнения обязательств центрального контрагента (ЦК), ответственное подразделение к материалам прилагает следующие документы:

- 1) сведения об остатках на корреспондентских счетах Биржи (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2020 года*);
  - 2) сведения о предстоящих переводах денег в пользу клиринговых участников с корреспондентских счетов Биржи (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2020 года*);
  - 3) сведения о ценных бумагах, поступивших на собственный торгово-клиринговый счет ЦК вследствие переноса позиции недобросовестного клирингового участника подразделением клиринга.
3. При вынесении на рассмотрение Комитета вопроса о заключении сделок, направленных на урегулирование дефолта несостоятельного клирингового участника, ответственное подразделение к материалам прилагает следующие документы:
- 1) сведения об обязательствах и требованиях по деньгам несостоятельного клирингового участника;
  - 2) сведения об обязательствах и требованиях по ценным бумагам несостоятельного клирингового участника;
  - 3) сведения о позициях по деньгам клирингового участника;
  - 4) сведения о ценных бумагах, находящихся на разделе KASE клирингового участника;
  - 5) рекомендации о параметрах сделок, направленных на урегулирования дефолта.
4. Материалы представляется секретарю Комитета не позднее начала заседания Комитета.

#### **Статья 6. Протокол заседания Комитета**

1. Решение Комитета по условиям заключения сделок оформляется в соответствии с приложением 1 к настоящему Положению, содержит указания по заключению сделок и подписывается всеми членами Комитета, принимавшими участие в заседании.
2. Помимо решения, также оформляется протокол заседания Комитета, который подлежит составлению и предоставлению секретарем Комитета на согласование членам Комитета, принимавшим участие в заседании, в течение двух рабочих дней со дня проведения заседания.  

Направление протокола заседания на согласование членам Комитета в соответствии с абзацем первым настоящего пункта осуществляется с использованием корпоративной электронной почты.

Протокол подлежит доработке секретарем Комитета при наличии замечаний и/или предложений членов Комитета, участвовавших на заседании, к проекту протокола.
3. Протокол заседания Комитета должен содержать следующие сведения:
  - 1) полное наименование Комитета и место заседания Комитета;
  - 2) дату, время и место проведения заседания;
  - 3) сведения о лицах, участвовавших в заседании;
  - 4) повестку дня заседания;
  - 5) вопросы, поставленные на голосование, и итоги голосования по ним;
  - 6) принятые решения, оформленные в соответствии с приложением 1 к настоящему Положению;

- 7) иные сведения по решению Комитета.
4. Протокол подписывает Председатель Комитета. Секретарь обеспечивает ознакомление членов Комитета с протоколом. Оригиналы протоколов заседаний Комитета, оригиналы решений, а также материалы по вопросам повестки дня Комитета хранятся у секретаря Комитета.
5. Секретарь Комитета осуществляет контроль и мониторинг исполнений решений (поручений) Комитета и предоставляет информацию о статусах их исполнения членам Комитета.

**Статья 7. Права, обязанность и ответственность членов Комитета**

1. При осуществлении функций, указанных в статье 3 настоящего Положения, Комитет имеет право:
  - 1) предварительно изучать и рассматривать любые вопросы, отнесенные к его компетенции настоящим Положением и/или по поручению Правления Биржи;
  - 2) запрашивать у структурных подразделений Биржи необходимую информацию;
  - 3) привлекать работников структурных подразделений Биржи и/или внешних экспертов для участия в заседаниях Комитета;
  - 4) принимать решения в отношении условий заключения сделок направленных на урегулирование дефолтов на фондовом рынке, подлежащие исполнению подразделением, ответственным за управление ликвидностью ЦК;
  - 5) принимать решения в отношении условий заключения сделок, направленных на привлечение ликвидности в случае возникновения дефицита на корреспондентском счете Биржи в Центральном Депозитарии, подлежащих исполнению ответственным подразделением;
  - 6) принимать рекомендации Правления.
2. Члены Комитета и лица, уполномоченные (имеющие право) замещать членов Комитета, обязаны:
  - 1) быть независимыми и объективными;
  - 2) обеспечивать конфиденциальность информации, полученной ими в связи с осуществлением полномочий членов Комитета, в том числе информации, составляющей коммерческую, служебную или иную охраняемую законом тайну, и несут ответственность в соответствии с законодательством Республики Казахстан за нарушение такой обязанности.
3. Председатель, члены Комитета и лица, уполномоченные (имеющие право) замещать членов Комитета, несут ответственность за выполнение поставленных целей и функций согласно законодательству Республики Казахстан, настоящему Положению и другим внутренним документам Биржи.
4. Член Комитета вправе:
  - 1) инициировать рассмотрение Комитетом вопросов, соответствующих его основным задачам;
  - 2) получать информацию в объеме, необходимом и достаточном для формирования полноценного, обоснованного мнения по рассматриваемому Комитетом вопросу;

- 3) привлекать работников структурных подразделений Биржи и/или внешних экспертов для участия в заседаниях Комитета;
- 4) принимать иные меры, необходимые для выполнения поставленных перед ним как членом Комитета задач и функций.
5. Ответственность за своевременное предоставление членам Комитета материалов по вопросам, включенным в повестку дня заседания Комитета, несет секретарь Комитета.

Секретарь Комитета также несет ответственность за разглашение конфиденциальной информации, полученной в рамках работы Комитета.

**Статья 8. Заключительные положения**

1. Ответственность за своевременное внесение в настоящее Положение изменений и/или дополнений (актуализацию) возлагается на Финансово-административный департамент.
2. Настоящее Положение подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в пять лет, исчисляемых со дня введения в действие настоящего Положения.

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.



**Приложение 1**

к Положению о Комитете по урегулированию дефолтов на фондовом рынке

**РЕШЕНИЕ**  
**по урегулированию дефолта**

[Дата]

**Привлечение ликвидности для ЦК**

Сумма к привлечению:

**Урегулирование дефолта клирингового участника**

Торговый счет, по которому произошел дефолт: [торговый код]

Код фирмы: [код фирмы]

Вид дефолта: [вид дефолта]

Дата признания клирингового участника несостоятельным: [дата и номер протокола]

**Характеристики заявок на заключение сделки  
методом непрерывного встречного аукциона**

1) Код режима: [Указать код режима в ТКС ASTS+]

Тип заявки: [Лимитная/Рыночная]

Код инструмента: [код финансового инструмента]

ISIN: [ISIN бумаги (при наличии)]

Направление: [Указать направление сделки]

Количество лотов: XXXX

Ценовой диапазон: не менее XXXX, но не более XXXX

Дополнительные комментарии и условия (при их наличии):

2) Код режима: [Указать код режима в ТКС ASTS+]

Тип заявки: [Лимитная/Рыночная]

Код инструмента: [код финансового инструмента]

ISIN: [ISIN бумаги (при наличии)]

Направление: [Указать направление сделки]

Количество лотов: XXXX

Ценовой диапазон: не менее XXXX но не более XXXX

Дополнительные комментарии и условия (при их наличии):

...

**Характеристики заявок  
на заключение сделки методом прямых сделок**

- 1) Код режима: [Указать код режима в ТКС ASTS+]  
Тип заявки: [Лимитная/Рыночная]  
Код инструмента: [код финансового инструмента]  
ISIN: [ISIN бумаги (при наличии)]  
Направление: [Указать направление сделки]  
Код участника контрагента: [код фирмы]
- Количество лотов: XXXX  
Цена: не менее XXXX но не более XXXX

**Другие предложенные котировки**

- 1) Код режима: [Указать код режима в ТКС ASTS+]  
Тип заявки: [Лимитная/Рыночная]  
Код инструмента: [код финансового инструмента]  
ISIN: [ISIN бумаги (при наличии)]  
Направление: [Указать направление сделки]  
Код участника контрагента: [код фирмы]
- Количество лотов: XXXX  
Цена: не менее XXXX но не более XXXX

**Особое мнение членов комитета**

\* \* \*

Комитет поручает ответственному подразделению урегулировать дефолт клирингового участника в рамках установленной последовательности.

**Срок действия решения:**

**Дата:**

**период времени:**

Члены Комитета:

<b>член Комитета 1</b>	<b>[Подпись]</b>
<b>член Комитета 2</b>	<b>[Подпись]</b>
<b>член Комитета 3</b>	<b>[Подпись]</b>
<b>член Комитета 4</b>	<b>[Подпись]</b>
<b>член Комитета 5</b>	<b>[Подпись]</b>

Исполнитель решения Комитета

**Сотрудник ответственного подразделения**

**[Подпись]**