

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Басқармасының шешімімен

(2019 жылдың 01 қарашасындағы
№ 135 отырыс хаттамасы)
б е к і т і л г е н

2019 жылдың 03 желтоқсанынан бастап
қолданысқа енгізілді

Репо нарығының ОК-пен индикативтік көрсеткіштерін есептеу **Ә Д І С Т Е М Е С І**

Алматы қ.

2019

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. № 1 толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2021 жылдың 12 тамызындағы № 86 отырыс хаттамасы);
- 2021 жылдың 18 тамызынан бастап қолданысқа енгізілді.

2. № 2 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2022 жылдың 04 тамызындағы № 95 отырыс хаттамасы);
- 2022 жылдың 22 тамызынан бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Әдістеме "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) Орталық контрагенттің қызметтерін пайдалана отырып, қор нарығында клирингтік қызметті жүзеге асыратын қаржы құралдарымен репо нарығының индикативтік көрсеткіштерінің тізбесін (бұдан әрі – ОК-пен репо) және осы көрсеткіштерді есептеу тәртібін анықтайды.

1 тарау. ЖАЛПЫ ҚАҒИДАЛАР

1. Осы Әдістемеді Биржаның басқа ішкі құжаттарымен анықталған ұғымдар қолданылады.
2. Әдістеме мақсаттары үшін:
 - 1) репо нарығының ОК-пен мәмілелері деп Орталық контрагенттің қызметтерін пайдалана отырып, Биржа өткізетін сауда-саттықта жасалған қаржы құралдарымен автоматты репо операцияларының мәмілелері түсініледі;
 - 2) қаржы құралдары деп "Қаржы құралдарын Т+ Тізіміне және Т+ қамтамасыз ету Тізіміне енгізу тәртібі" атты Биржа құжатымен анықталған Т+тізіміне енгізілген туынды бағалы қағаздарды қоса алғанда, бағалы қағаздар түсініледі";
 - 3) қандай да бір қаржы құралы үшін нәтижелі күн деп осы қаржы құралымен Биржаның сауда-саттық жүйесінде ең болмағанда бір мәміле жасалған күн түсініледі;
 - 4) КҚС деп орталық контрагенттің функцияларын орындайтын, оның иесінің Биржаның мүліктік кепілдік қорындағы активтердің үлесіне құқығын куәландыратын клирингтік ұйым ретінде Биржа шығаратын эмиссиялық емес бағалы қағаз түсініледі (*осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген*);
 - 5) МБҚ қоржыны деп Биржаның ішкі құжаттарына сәйкес анықталған бағалы қағаздардың тізімі түсініледі (*осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген*).
3. Биржа репо нарығының қаржы құралдарымен ОК-пен мәмілелер бойынша мынадай индикативтік көрсеткіштерді (бұдан әрі – индикаторлар) есептейді:
 - 1) REPOUS1D – бір күн мерзімге АҚШ долларымен есеп айырысумен ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 4) REPOUS1W – есептесуі АҚШ долларымен ОК-пен жеті күн мерзімге автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 5) REPOUS14D – есептесуі АҚШ долларымен ОК-пен он төрт күн мерзімге автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 7) REPOUS30D – есептесуі АҚШ долларымен ОК-пен отыз күн мерзімге автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 8) REPObn1D – есептесуі теңгемен бір күн мерзімге борыштық бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 11) REPObn1W – есептесуі теңгемен жеті күн мерзімге борыштық бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 12) REPObn14D – есептесуі теңгемен он төрт күн мерзімге борыштық бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 13) REPObn30D – теңгемен есептесулері бар, мерзімі отыз күн борыштық бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 14) REPOsh1D – есептесуі теңгемен бір күн мерзімге үлестік бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;

- 17) REPOsh1W – есептесуі теңгемен жеті күн мерзімге үлестік бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 18) REPOsh14D – есептесуі теңгемен он төрт күн мерзімге үлестік бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 19) REPOsh30D – есептесуі теңгемен отыз күн мерзімге үлестік бағалы қағаздар бойынша ОК-пен автоматты репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме;
 - 20) REPGCC_1D– есеп айырысуы теңгемен бір күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 21) REPGCC_1W – есеп айырысуы теңгемен жеті күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 22) REPGCC_2W– есеп айырысуы теңгемен он төрт күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 23) REPGCC_1M– есеп айырысуы теңгемен отыз күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 24) REPGCC_2M– есеп айырысуы теңгемен алпыс күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 25) REPGCC_3M– есеп айырысуы теңгемен тоқсан күн мерзімге КҚС-пен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*.
 - 26) REPOgb14D– есеп айырысуы теңгемен он төрт күн мерзімге МБҚ қоржынымен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 27) REPOgb30D– есеп айырысуы теңгемен отыз күн мерзімге МБҚ қоржынымен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*;
 - 28) REPOgb90D– есеп айырысуы теңгемен тоқсан күн мерзімге МБҚ қоржынымен репо операциялары бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен енгізілген)*.
4. Осы Әдістемеді пайдаланылатын терминдер Биржаның басқа ішкі құжаттарында, қызметтік құжаттамада, Биржаның хат алмасуында және биржалық ақпаратта да қолданылуы мүмкін.
 5. Осы Әдістемеге өзгертулер және/немесе толықтырулар, редакциялық және/немесе нақтылаушы сипатқа ие және тәртіпке әсер етпейтін өзгерістерді және/немесе толықтыруларды қоспағанда, осы өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізілген күнге дейін кемінде 10 күн бұрын Биржаның ресми интернет-сайтында орналастырылуға (жариялануға) жатады.

2 тарау.ИНДИКАТОРЛАРДЫ ЕСЕПТЕУДІҢ ЖАЛПЫ ШАРТТАРЫ

6. Индикаторлардың мәндерін Биржа математикалық дөңгелектеу ережелері бойынша (беске дейінгі сандар нөлге дейін азаяды, ал бес және одан жоғары сандар онға дейін артады) дөңгелектеу арқылы үтірден кейін екі таңбаға дейінгі дәлдікпен есептейді *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен өзгертілген)*.

7. Сауда-саттық күні ішінде параметрлері қандай да бір индикаторды есептеуді жүзеге асыру үшін қажет мәмілелер болмаған кезде, осы күні осы индикаторды есептеу жүргізілмейді.
8. Индикаторлар мәндерінің қаржы нарығының объективті сипаттамаларына барабарлығын қамтамасыз ету мақсатында осы мәндерді Индекстер мен индикаторлар жөніндегі комитет түзетуі мүмкін. Мұндай түзетудің шарттары мен тәртібі осы Әдістеменің 4 тарауында анықталған *(осы тармақ Биржа Басқармасының 2021 жылдың 12 тамызындағы шешімімен өзгертілген)*.

3 тарау. РЕПО ОПЕРАЦИЯЛАРЫ НАРЫҒЫНЫҢ ИНДИКАТОРЛАРЫН ЕСЕПТЕУ

9. Репо операциялары нарығының индикаторларын есептеу мәмілелердің жасалуына қарай Биржаның әрбір сауда-саттық күні ішінде жүзеге асырылады. Индикаторлардың әрбір жаңа мәнін есептеу тиісті қаржы құралы бойынша репо операциясын ашудың әрбір мәмілесі жасалғаннан кейін жүргізіледі.
10. Осы Әдістеменің 3 тармағында көрсетілген индикаторлар индикаторды есептеу сәтінде оны есептеу күні ОК репо операцияларын ашудың барлық мәмілелерінің параметрлері негізінде мынадай формула бойынша есептеледі:

$$Y = \frac{\sum_{i=1}^n (V_i \times Y_i)}{\sum_{i=1}^n V_i}, \text{ мұнда:}$$

Y – орташа сараланған репо мөлшерлемесі жылдық %-бен;

V_i – РЕПО операциясын ашудың I-ші мәмілесінің көлемі теңгемен;

Y_i – РЕПО операциясын ашудың I-ші мәмілесі бойынша репо мөлшерлемесі жылдық %-бен;

n – репо операцияларын ашу мәмілелерінің саны.

11. Индикаторларды есептеу Биржаның "ASTS+ сауда-клирингтік жүйесінде репо операцияларын жүзеге асыру ережелері" атты ішкі құжатында белгіленген репо ашу және жабу мәмілелерін жасасу ерекшеліктері ескеріле отырып жүргізіледі *(осы тармақ Биржа Басқармасының 2022 жылдың 04 тамызындағы шешімімен өзгертілген)*.
12. Индикаторларды есептеу үтірден кейін екі белгіге дейінгі дәлдікпен жүзеге асырылады және пайызбен көрсетіледі.

4 тарау. ТАРАУ. ИНДЕКСТЕР МЕН ИНДИКАТОРЛАР БОЙЫНША КОМИТЕТТИҢ ИНДИКАТОРЛАРҒА ҚАТЫСТЫ АЙРЫҚША ӨКІЛЕТТІКТЕРІ

(Осы тақырыптама Биржа Басқармасының 2021 жылдың 12 тамызындағы шешімімен өзгертілген)

13. Индекстер мен индикаторлар жөніндегі комитет (бұдан әрі – Комитет) олардың есептеулерінен Комитеттің пікірі бойынша осы мәндерге (мысалы, орындалмаған мәмілелердің, жасалуы кезінде техникалық қателіктер жіберілген мәмілелердің, бағалары тиісті құралдар бағасының нарықтық жай-күйіне және/немесе нарықтық динамикасына анық сәйкес келмейтін мәмілелердің) жағымсыз әсер ететін (әсер еткен) мәмілелердің параметрлерін алып тастай отырып, индикаторлардың мәндерін түзетуге құқылы *(осы тармақ Биржа Басқармасының 2021 жылдың 12 тамызындағы шешімімен өзгертілген)*.
14. Комитет қандай да бір индикатордың есебінен қандай да бір мәміленің (қандай да бір мәмілелердің) параметрлерін алып тастау туралы шешім қабылдаған жағдайда, осы индикаторды тиісті қайта есептеу осы индикатордың репрезентативтік емес мәні алынған күннен кейінгі жұмыс күнінен кешіктірілмей жүзеге асырылады.
15. Комитет осы Әдістеменің 13 тармағына сәйкес өзінің айрықша өкілеттіктерін пайдаланған кезде оның отырысының хаттамасында осы өкілеттіктерді пайдалану себептері және оның осы өкілеттіктерге сәйкес қабылдаған әрекеттері көрсетілуге тиіс.

5 тарау. ТҰЖЫРЫМДЫ ҚАҒИДАЛАР

16. Осы Әдістемеге өзгертулерді және/немесе толықтыруларды уақтылы енгізу (өзектілендіру) үшін жауапкершілік Ақпарат және статистика департаментіне жүктеледі.
17. Осы Әдістеме қажеттілігіне қарай, бірақ үш жылда кемінде бір рет өзектілендіруге жатады.

Басқарма Төрайымы

А.Ө. Алдамберген.