

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н о

решением Правления
ЗАО "Казахстанская фондовая биржа"

от 17 января 2003 года № 8/1

Введено в действие

с 20 января 2003 года

ПОЛОЖЕНИЕ о Рисковом комитете

г. Алматы

2003

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 15 января 2004 года № 1 (з)) во всех внутренних документах биржи произведена замена слов "закрытое акционерное общество "Казахстанская фондовая биржа"" на "акционерное общество "Казахстанская фондовая биржа"" в соответствующих падежах и "ЗАО "Казахстанская фондовая биржа"" на "АО "Казахстанская фондовая биржа"".
2. **Дополнения № 1:**
 - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" от 14 августа 2008 года № 107/0;
 - введены в действие с 14 августа 2008 года.
3. **Дополнения № 2:**
 - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" от 10 ноября 2010 года № 393;
 - введены в действие с 10 ноября 2010 года.

Настоящее Положение определяет порядок создания и работы, а также функции и полномочия Рискового комитета АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) *(данный абзац изменен решением Биржевого совета от 15 января 2004 года)*.

1. Рисковый комитет Биржи (далее – Комитет) формируется из числа работников Биржи, один из которых является председателем Комитета, а остальные – членами Комитета.

Количественный и персональный составы Рискового комитета определяются приказами Президента Биржи или Вице-президента Биржи, его замещающего. При этом председателем Комитета назначается, как правило, один из членов Правления Биржи.

Приказами Президента Биржи или Вице-президента Биржи, его замещающего, может быть также установлен порядок замещения отсутствующих председателя и/или членов Комитета.

2. Основными функциями Комитета являются:

- 1) разработка методических основ оценки ценных бумаг и других финансовых инструментов для целей, предусмотренных внутренними документами Биржи (далее – Оценка);

- 2) установление параметров, используемых при автоматизированной Оценке и установление которых отнесено внутренними документами Биржи к компетенции Комитета;

- 2-1) формирование представительских списков для расчета индикаторов фондового рынка в соответствии с внутренними документами Биржи *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 14 августа 2008 года)*;

- 2-2) определение количества акций, которые находятся в свободном обращении, для целей расчета фондового индекса *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 14 августа 2008 года)*;

- 2-3) определение риск-параметров на срочном рынке *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 10 ноября 2010 года)*;

- 2-4) контроль достаточности размеров резервного и гарантийных фондов на срочном рынке *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 10 ноября 2010 года)*;

- 3) иные функции, предусмотренные внутренними документами Биржи.

3. Комитет вправе:

- 1) в случаях, предусмотренных внутренними документами Биржи:

осуществлять внеочередное установление параметров, используемых при автоматизированной Оценке;

изменять установленные внутренними документами Биржи параметры, используемые при автоматизированной Оценке;

самостоятельно осуществлять неавтоматизированную Оценку;

исключать из расчета индикаторов фондового рынка параметры отдельных сделок, заключенных на проводимых Биржей торгах, и заявок на заключение сделок на проводимых Биржей торгах *(данный абзац включен решением Правления Биржи от 14 августа 2008 года)*;

изменять действующие риск-параметры на срочном рынке *(данный абзац включен решением Правления Биржи от 10 ноября 2010 года)*;

готовить рекомендации по изменению размеров обязательного гарантийного взноса на срочном рынке и размера резервного фонда (утверждаемые Биржевым советом) *(данный абзац включен решением Правления Биржи от 10 ноября 2010 года)*;

- 2) осуществлять иные полномочия, предусмотренные внутренними документами Биржи.

4. Заседания Комитета проводятся с периодичностью и в сроки, установленные внутренними документами Биржи, а также в любое время по поручению Президента Биржи или Вице-президента Биржи, его замещающего, либо по инициативе председателя Комитета.
5. Комитет правомочен принимать решения, если в его заседании участвует не менее двух третей членов Комитета или лиц, имеющих право их замещать.

Если приказами Президента Биржи или Вице-президента Биржи, его замещающего, не определено лицо, имеющее право замещать председателя Комитета, при его отсутствии созыв и ведение заседания Комитета осуществляются одним из членов Правления Биржи по поручению Президента Биржи или Вице-президента Биржи, его замещающего.

6. Решения Комитета оформляются протоколами, подписываемыми участвовавшими в его заседании лицами.

Президент

Джолдасбеков А.М.