

# "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

---

---

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
Директорлар кеңесінің шешімімен  
(2018 жылдың 09 шілдесіндегі  
№ 20 отырыс хаттамасы)

**б е к і т і л д і**

2018 жылдың 01 қазанынан бастап  
**қолданысқа енгізілді**

## Активтерді инвестициялау ЕРЕЖЕЛЕРІ

---

---

Алматы қ.

2018

## **ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ**

### **1. № 1 өзгертулер мен толықтырулар:**

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен (2020 жылдың 13 сәуіріндегі № 12 отырыс хаттамасы) бекітілді;
- 2020 жылдың 14 сәуірінен бастап қолданысқа енгізілді.

### **2. № 2 өзгертулер:**

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен (2020 жылдың 02 желтоқсанындағы № 40 отырыс хаттамасы) бекітілді;
- 2020 жылдың 03 желтоқсанынан бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Ережелер "Бағалы қағаздар нарығы туралы" Қазақстан Республикасының Заңына Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2015 жылдың 19 желтоқсандағы № 252 қаулысымен бекітілген Қор биржасы үшін тәуекелдерді басқару және ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру ережелеріне (бұдан әрі – № 252 Ережелер), Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2012 жылғы 24 ақпанындағы № 59 қаулысымен бекітілген Клирингілік ұйымның тәуекелдерді басқару жүйесіне, клирингілік ұйымындағы тәуекелдерге мониторинг жүргізу, бақылау және басқару шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптарға (бұдан әрі – № 59 Талаптар), Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2015 жылғы 19 желтоқсандағы "Сауда-саттықты ұйымдастырушының ұйымдық құрылымына және қор биржасының листингтік комиссиясының құрамына қойылатын талаптарды, сондай-ақ қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын сауда-саттықты ұйымдастырушының құрылымдық бөлімшесінің қызметін жүзеге асыру қағидаларын бекіту туралы" № 249 қаулысына, Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2020 жылдың 30 наурызындағы № 40 қаулысымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызмет түрлерін жүзеге асыруға лицензиялар беру, тоқтата тұру және одан айыру ережелеріне, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылдың 28 қаңтарындағы № 11 қаулысымен бекітілген Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдеріне мониторинг жүргізу, бақылау және басқару шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптарға сәйкес әзірленді және "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) активтерін инвестициялау кезінде қаржы құралдарымен мәмілелер жасау тәртібін анықтайды (*осы алғысөз Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 02 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілген*).

## 1 тарау. ЖАЛПЫ ҚАҒИДАЛАР

### 1 бап. Биржа активтерін инвестициялау туралы жалпы ережелер

1. Биржаның меншікті активтерін (бұдан әрі – активтер) қоса алғанда, Биржа активтерін инвестициялау шарттары Биржаның "Активтерді Инвестициялық саясаты" атты ішкі құжатында (бұдан әрі – Инвестициялық саясаты) анықталған.
2. Биржаның меншікті активтерін қоса алғанда, активтер есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер Биржаның Инвестициялық комитеті (бұдан әрі – Инвестициялық комитет) қабылдаған Инвестициялық шешімдерге сәйкес жасалады.

### 2 бап. Биржа активтерін инвестициялау ерекшеліктері

1. Биржа активтерін Инвестициялық саясатына (бұдан әрі – Инвестициялық саясаты) сәйкес Биржа активтерін инвестициялау стратегиясы үш инвестициялық портфельді қалыптастыру және оқшаулау болып табылады:
  - 1) сақтық қорларды қоспағанда, Биржаның меншікті портфелі;
  - 2) клирингілік қорлардың портфелі (кепілдік және сақтық қорлар);
  - 3) клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі.
2. Үш инвестициялық портфельдің құрамына кіретін активтерді оқшаулау және есепке алу үшін Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитеттің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) Биржа бухгалтериясының деректері негізінде Инвестициялық саясатына сәйкес бөлек қалыптастырылған әрбір инвестициялық портфельдің басқарушылық есебін талдайды және жүргізеді.
3. Биржа активтерін инвестициялау Инвестициялық саясаттың 1-3 қосымшаларына сәйкес үш портфель тұрғысынан Инвестициялық комитеттің шешімдеріне сәйкес жүзеге асырылады..

4. Клирингілік қорлардың портфелін және клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелін құрайтын ақшаны инвестициялаудан түскен кірістер клирингілік қатысушыларды және клирингілік қорларды қамтамасыз ету құрамына енгізілмейді, Биржаның инвестициялық қызметінен түскен кірістердің құрамына енгізіледі.

## 2 тарау. Инвестициялық комитет

### Статья 3. Инвестициялық комитет тің құрамы. Инвестициялық комитет тің функциялары

1. Инвестициялық комитет Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық шешімдер қабылдау мақсатында құрамында кемінде үш адам құрылады.

Инвестициялық комитет мүшелерінің кемінде жартысы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеуді, бақылауды және қадағалауды жүзеге асыратын уәкілетті органның оларды Биржаның басшы қызметкерлері етіп тағайындауға (сайлауға) келісімін алған Биржаның басшы қызметкерлері болуы тиіс ("Бағалы қағаздар нарығы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 72 бабы 1 тармағының талаптарына сәйкес) *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 02 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілді)*.

2. Инвестициялық комитет тің құрамына мыналар кіреді:
  - 1) Биржа Басқармасының мүшелері (Инвестициялық комитет мүшелерінің жалпы санының кемінде жартысы);
  - 2) Биржаның тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесінің басшысы;
  - 3) Биржаның атқарушы органының ұсынысы бойынша оның басқа лауазымды тұлғалары мен қызметкерлері.
3. Инвестициялық комитет тің құрамын Биржа Басқармасы бекітеді.

Басқарма Биржа Басқармасының мүшелері болып табылатын Инвестициялық комитет мүшелерінің арасынан Инвестициялық комитет тің төрағасын және Инвестициялық комитет тің төрағасы болмаған жағдайда Инвестициялық комитет төрағасының орынбасарын тағайындайды.
4. Инвестициялық комитет тің функциялары:
  - 1) Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық шешімдер қабылдау;
  - 2) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің жай-күйін (Биржа активтерін инвестициялау нәтижелерін) және Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің үш портфель бөлінісінде тәуекелдерге ұшырауын талдау нәтижелерін қарау;
  - 3) инвестициялау саясатына өзгертулер мен толықтырулардың жобаларын немесе оның жаңа редакциядағы жобаларын келісу;
  - 4) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдарына қатысты Биржаның ниетін анықтау;
  - 5) Қазақстан Республикасының заңнамасына, осы Ережелерге және Биржаның басқа да ішкі құжаттарына, Биржаның Директорлар кеңесінің шешімдеріне сәйкес өзге де функциялар.

4 бап.

**Инвестициялық комитет тің отырыстары.**

**Инвестициялық комитет отырысының хаттамасы**

1. Инвестициялық комитет тің отырыстары қажеттілігіне қарай, бірақ күнтізбелік тоқсанда кемінде бір рет өткізіледі.
2. Инвестициялық комитет тің отырысы Инвестициялық комитет төрағасының немесе Инвестициялық комитет төрағасы орынбасарының бастамасы бойынша шақырылады.
3. Инвестициялық комитет отырысының кворумы бір мезгілде мынадай шарттар сақталған кезде анықталады:
  - 1) егер Инвестициялық комитет тің отырысына Инвестициялық комитет мүшелері жалпы санының кемінде жартысы қатысса;
  - 2) Инвестициялық комитет тің қатысып отырған мүшелерінің кемінде жартысы Биржа Басқармасының мүшелері болып табылады.

Инвестициялық комитет тің отырысын осы отырыстың төрағасы – Инвестициялық комитет тің төрағасы немесе Инвестициялық комитет төрағасының орынбасары жүргізеді.

4. Инвестициялық комитет тің отырысын өткізбестен шешімдер қабылдауға тыйым салынады.
5. Инвестициялық комитет тің әрбір мүшесі бір дауысқа ие.

Инвестициялық комитет мүшесі өзге тұлғаларға Инвестициялық комитет тің шешімдерін қабылдауға қатысу жөніндегі өз өкілеттіктерін беруге құқылы емес.

Инвестициялық комитет тің мүшесі Инвестициялық комитет тің осы мүшесінің мүдделері мен Инвестициялық комитет тің қарауына жататын қандай да бір мәселе бойынша Биржаның мүдделері бір-біріне сәйкес келмейтін мән-жайлардың болуы туралы ақпаратты Биржа Басқармасының назарына жеткізуге міндетті. Осындай мән-жайлар болған кезде Инвестициялық комитет тің осы мүшесі көрсетілген мәселе қаралатын Инвестициялық комитет тің отырысына қатысуға және көрсетілген мәселе бойынша Инвестициялық комитет қабылдайтын шешімге кез келген түрде ықпал етуге құқылы емес. Мұндай мән-жайлардың болуы фактісі осы отырыстың хаттамасында көрсетілуі тиіс.

Инвестициялық комитет тің шешімдері отырысқа қатысушы Инвестициялық комитет мүшелерінің жалпы санының жай көпшілік даусымен қабылданады. Дауыстар тең болған жағдайда Инвестициялық комитет отырысы төрағасының дауысы шешуші болып табылады.

6. Инвестициялық комитет тің шешімдері оның отырысының хаттамасымен ресімделеді, оған осы отырыс төрағасы, отырысқа қатысқан Инвестициялық комитет мүшелері және Инвестициялық комитет тің хатшысы осы отырыс өткізілген күннен бастап келесі жұмыс күнінен кешіктірмей жасауға, қол қоюы тиіс. Инвестициялық комитет отырысының хаттамасында Инвестициялық комитет мүшесінің ерекше пікірі қамтылады (егер дауыс беру кезінде Инвестициялық комитет мүшесі ерекше пікір білдірсе).
7. Инвестициялық комитет отырысының хаттамасында мынадай мәліметтер қамтылуы тиіс:
  - 1) осы отырыстың өткізілетін күні, уақыты және орны;
  - 2) Инвестициялық комитет тің осы отырысқа қатысқан мүшелері және осы отырысқа қатысқан адамдар туралы мәліметтер;
  - 3) отырыста қаралған мәселелердің тізбесі;
  - 4) Инвестициялық комитет тің осы отырысқа қатысушылардың дауыс беруіне қойылған шешімдері негіздемелерінің қысқаша сипаттамасы;

- 5) Инвестициялық комитет тің осы отырысқа қатысушылардың дауыс беруіне қойылған шешімдерінің тұжырымдары;
- 6) инвестициялық шешім қабылдау үшін Инвестициялық комитет ке ұсынылған құжаттардың тізбесі;
- 7) қаржы құралдарының атауын, сондай-ақ олармен мәмілелер жасасу шарттарын көрсете отырып, отырыста қабылданған Инвестициялық шешімдердің параметрлері;
- 8) Инвестициялық комитет қабылдаған шешімдердің тұжырымдары;
- 9) отырыста қаралатын әрбір мәселе бойынша осы отырысқа қатысушылардың дауыс беру қорытындылары ("Қолдаймын", "Қарсымын", "Қалыс қалды" нұсқалары бойынша дауыс берген осы отырысқа қатысушыларды анықтауға мүмкіндік беретін мәліметтерді көрсете отырып);
- 10) Инвестициялық комитет тің әрбір мүшесінің негіздемесі және күтілетін нәтижесі бар мәселе мен ұсынылатын шешім жобасы бойынша, оның ішінде олар қабылданған шешіммен келіспеген және ерекше пікірі болған жағдайда пікірі;
- 11) осы Ережелердің 9 бабының 5 тармағына сәйкес өзге де мәліметтер.

**5 бап.**

**Инвестициялық комитет тің хатшысы**

1. Инвестициялық комитет тің хатшысы Биржа Басқармасының шешімімен Инвестициялық комитет тің мүшелері болып табылмайтын Биржа қызметкерлерінің арасынан тағайындалады.
2. Инвестициялық комитет тің хатшысы мынадай функцияларды жүзеге асырады:
  - 1) Инвестициялық комитет тің отырысы өткізілетіні туралы оның мүшелеріне және осы отырысқа қатысуға құқығы бар немесе міндетті басқа да адамдарға хабарлайды;
  - 2) Инвестициялық комитет отырысының күн тәртібіндегі мәселелер бойынша материалдарды қалыптастырады (толықтығы мен сапасын бір мезгілде бақылай отырып) және отырыста осы материалдарды Инвестициялық комитет мүшелеріне және Инвестициялық комитет төрағасының немесе Инвестициялық комитет төрағасы орынбасарының шешіміне сәйкес осы отырысқа қатысуға құқығы бар немесе міндетті басқа адамдарға ұсынады;
  - 3) Инвестициялық комитет тің отырысын өткізуді ұйымдастырады;
  - 4) Инвестициялық комитет отырысы хатшысының функцияларын жүзеге асырады, оның ішінде:

осы отырыстың кворумына есеп жүргізеді;

осы отырысқа қатысушылардың дауыс беруіне қойылған шешімдер бойынша осы отырысқа қатысушылардың дауыстарын есептейді және осындай дауыс берудің қорытындыларын шығарады;

осы отырыстың хаттамасын жасайды;
  - 5) әрбір портфель бойынша Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық комитет қабылдаған Инвестициялық шешімдерді меншікті ресімдейді және осы шешімдерді Биржа бухгалтериясына орындауға береді;
  - 6) Инвестициялық комитет отырыстары хаттамаларының түпнұсқаларын және үш портфель бойынша Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық комитет

қабылдаған Инвестициялық шешімдерді, сондай-ақ Инвестициялық комитет отырыстарының күн тәртібі мәселелері бойынша материалдардың бақылау даналарын сақтайды;

- 7) Биржа активтерінің (мемлекеттік бағалы қағаздармен мәмілелерді қоспағанда) есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау жөніндегі әрбір Инвестициялық шешім бойынша құжаттар жинағын қалыптастырады:

осы Ережелердің 7 бабына сәйкес әзірленген ұсынымдардың көшірмелері;

осы Ережелердің 8 бабына сәйкес берілген қорытындының көшірмелері;

осы Ережелердің 9 бабына сәйкес қабылданған Инвестициялық шешімнің көшірмелері;

осы Ережелердің 10 бабына сәйкес ресімделген клиенттік тапсырыстардың немесе төлем тапсырмаларының көшірмелері;

Биржа брокерінің осы Ережелердің 10 бабына сәйкес алынған мәмілелер туралы есептерінің көшірмелері немесе осы Ережелердің 10 бабына сәйкес жасалған банктік салым (шот) шартының көшірмелері;

- 8) уәкілетті тұлғалардың сұраныстары бойынша Инвестициялық комитет отырыстарының хаттамаларынан үзінді көшірмелер және Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық комитет қабылдаған Инвестициялық шешімдердің көшірмелерін дайындайды;

- 9) *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен алынып тасталды);*

- 10) Инвестициялық комитет шешімдерінің орындалуын бақылауды және мониторингілеуді жүзеге асырады және ай сайын Инвестициялық комитет төрағасына олардың орындалу мәртебесі туралы ақпараты бар қызметтік жазбаны ұсынады;

- 11) осы Ережелерге сәйкес өзге де функциялар.

3. Инвестициялық комитет тің хатшысы болмаған жағдайда оның функцияларын осы мақсатта Биржа Басқармасы Инвестициялық комитет тің мүшелері болып табылмайтын Биржа қызметкерлерінің қатарынан тағайындаған Биржа қызметкері жүзеге асырады.

### 3 тарау. Инвестициялық шешімдерді қабылдау және орындау

#### 6 бап.

#### Инвестициялық шешімдерді қабылдау және орындау туралы жалпы қағидалар

1. Инвестициялық комитет Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) ұсынымдары және осы ұсынымдар бойынша Биржаның тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесінің қорытындысы негізінде Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Инвестициялық шешімдер қабылдайды.

2. Осы тараудың мақсаттары үшін мынадай қысқартылған белгілер пайдаланылады:

- 1) "Инвестициялық шешім" – Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасау жөніндегі Инвестициялық шешім;

- 2) "Ұсыным" – Инвестициялық шешім қабылдау мақсатында Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) ұсынымы;
- 3) "Тұжырым" – Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің ұсыным бойынша тұжырымы.

**7 бап.**

**Ұсыным**

1. Ұсынымды Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) осы баптың 2-6 тармақтарына сәйкес өзі жүргізетін талдау нәтижелері бойынша күнтізбелік тоқсанда кемінде бір рет және/немесе мынадай оқиғалардың кез келгенінің туындауына қарай әзірлейді:
  - 1) минималды қолжетімді бағалар (кірістіліктің (сыйақының) максималды қолжетімді мөлшерлемелері) бойынша және Биржаның әрбір инвестициялық портфельі бойынша минималды транзакциялық шығындармен қаржы құралдарына салу үшін жеткілікті мөлшерде Биржаның портфельінде/портфельдерінде ақша жинақтау;
  - 2) Биржа да қаржы құралдарына салуға болатын ақшаның болуы (күтілетін туындауы);
  - 3) Биржа да шығындар мен міндеттемелерді орындау үшін қажетті ақшаның болмауы. Осы оқиға кепілдік қорларының портфельіне және/немесе клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфельіне кіретін ақшаны пайдалану үшін негіз бола алмайды;
  - 4) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдері құрамының және/немесе құрылымының Инвестициялық саясаты на сәйкес келмеуі;
  - 5) Биржаның инвестициялық портфельдерін оңтайландыру қажеттілігінің немесе мүмкіндігінің туындауы (кірістілік пен өтімділікті арттыру, Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдары бойынша тәуекелдерді төмендету);
  - 6) Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің), Инвестициялық комитет төрағасының немесе оны алмастыратын тұлғаның пікірі бойынша осы талдауды жүргізу үшін жеткілікті негіз болып табылатын өзге оқиға.
2. Осы баптың 1 тармағында көрсетілген талдау мыналарды қамтиды:
  - 1) Биржаның инвестициялық портфельдерінің жай-күйін талдау;
  - 2) Инвестициялау саясатына сәйкес Биржа активтерін инвестициялау мүмкін болатын қаржы құралдарын талдау немесе Биржаның инвестициялық портфельдерінен алынуы мүмкін қаржы құралдарын талдау.
3. Осы баптың 1 тармағында көрсетілген талдауды жүргізу үшін Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) кез келген қолжетімді (инсайдерліктен басқа) және сенімге ие ақпаратты, оның ішінде:
  - 1) мемлекеттік органдардан, қор Биржа ларынан, рейтинглік агенттіктерден туындайтын;
  - 2) талдамалық зерттеулер мен шолуларда қамтылған (мұндай зерттеулер мен шолулардың авторларына немесе баспагерлеріне біржақтылық пен объективтілікке қатысты шағымдар болмаған жағдайда);

- 3) қаржы құралдары эмитенттерінің (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің) қаржылық есептілігінде, есептерінде, баспасөз мәлімеделерінде және өзге де материалдарында қамтылған;
  - 4) Биржаның қаржылық және басқарушылық есептілігіне енгізілген (Биржаның инвестициялық портфельдері туралы мәліметтер бөлігінде);
  - 5) қаржы құралдары эмитенттерінің (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің) интернет-сайттарында орналастырылған.
4. Инвестициялық портфельдердің жай-күйін талдау кезінде Биржа лар зерттеледі:
- 1) қаржы құралдарының эмитенттері (мерзімді салымдарға Биржаның активтері инвестицияланған Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері), қаржы құралдарының түрлері және олардың айналыс (өтеу) мерзімдері бөлінісінде Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрылымы;
  - 2) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамы мен құрылымының Инвестициялық саясатына сәйкестігі;
  - 3) Биржаның инвестициялық портфельдерінің нақты және күтілетін кірістілігі;
  - 4) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдарының осы құралдарды сатып алу бағаларымен арақатынасындағы нарықтық бағалары;
  - 5) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдары бойынша тәуекелдер және осындай тәуекелдердің Биржаның қаржылық жағдайына әсері;
  - 6) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдары эмитенттерінің (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің мерзімді салымдарына Биржа активтері инвестицияланған) қаржылық жағдайы.
5. Инвестициялау саясатына сәйкес Биржа активтерін инвестициялау мүмкін болатын қаржы құралдарын талдау кезінде зерттеледі:
- 1) осы қаржы құралдарына салуға болатын ақша мөлшері;
  - 2) осы қаржы құралдарының болуы (күтілетін туындауы), осы құралдарды орналастыру, айналысқа жіберу және өтеу шарттары;
  - 3) Биржа активтерін осы қаржы құралдарына инвестициялау шарттары, Биржаның инвестициялық портфельдерінің кірістілігі мен өтімділігін қолдау (арттыру) тұрғысынан Биржа үшін осындай шарттардың қолайлылығы;
  - 4) осы қаржы құралдары бойынша тәуекелдер, осындай тәуекелдердің Биржаның қаржылық жағдайына және Биржа үшін Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі белгілеген шектелімдерге әсері;
  - 5) Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамы мен құрылымының осы қаржы құралдарына Биржа активтерін инвестициялаған жағдайда Инвестициялау саясатына сәйкестігі;
  - 6) Биржа активтері осы қаржы құралдарына инвестицияланған жағдайда Биржаның инвестициялық портфельдерінің айналым шарттары және күтілетін кірістілігі;
  - 7) эмитенттердің және олар шығарған қаржы құралдарының қаржылық жай-күйін талдауды қоса алғанда, эмитенттерді және олар шығарған қаржы құралдарын талдау (мерзімді салымдарға Биржа активтерін инвестициялау мүмкін болатын Қазақстан Республикасының екінші

деңгейдегі банктері), оның активтері құнының одан әрі өсу әлеуеті, қабылданған міндеттемелер бойынша жауап беру қабілеті;

- 8) портфельдің құрылымы туралы мәліметтерді, кірістіліктің өзгеру динамикасын, залалды жайғасымдарды талдауды және инвестициялық портфельдер құрылымдарын оңтайландыру жөніндегі ұсынымдарды қамтитын активтер есебінен сатып алынған бағалы қағаздар портфелін талдау.
6. Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінен алынуы мүмкін қаржы құралдарын талдау кезінде зерделеуге жатады:
- 1) осы қаржы құралдарын Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінен алудан алу қажет ақша мөлшері;
  - 2) осы қаржы құралдарын Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінен алып қою шарттары, Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің кірістілігі мен өтімділігін қолдау (арттыру) тұрғысынан Биржа үшін осындай шарттардың қолайлылығы;
  - 3) Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамы мен құрылымының осы қаржы құралдары Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінен алынған жағдайда Инвестициялау саясатына сәйкестігі;
  - 4) осы қаржы құралдары Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінен алынған жағдайда Биржа активтерінің инвестициялық портфелінің күтілетін кірістілігі.
7. Ұсыным осы Ережелердің 1 қосымшасына сәйкес ресімделеді және осындай құжаттар мен материалдар болған кезде ұсынымдарды әзірлеу мақсатында талдау жүргізу үшін пайдаланылған ақпаратты қамтитын құжаттармен (құжаттардың көшірмелерімен) және материалдармен (материалдардың көшірмелерімен) қоса беріледі.
8. Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) қол қойған ұсыным қорытынды алу мақсатында Биржаның тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесіне беріледі.

Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеден қорытынды беру туралы ауызша хабарлама алғаннан кейін Биржаның қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) Инвестициялық шешімнің жобасын дайындайды және ұсынымды және осы жобаны Инвестициялық комитет тің хатшысына береді.

## 8 бап.

### Тұжырымдама

1. Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімше қорытындыны ұсыным алған күннен кейінгі екінші жұмыс күнінің Алматы уақытымен 18.00-ден кешіктірмей береді.
2. Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімше Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің кредиттік, бағалық, пайыздық және валюталық тәуекелдерге ұшырағыштығы туралы өз пікірін негізге ала отырып, Биржа активтерін инвестициялау процесінде Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысынан (немесес Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерден) алынатын ақпарат негізінде тұжырымдама дайындайды.

Қорытындыны дайындау кезінде ұсынылатын мәмілелердің Инвестициялау саясаты мен Инвестициялық комитет белгілеген шектелімдер мен басқа да шектеулерді сақтауға әсері де назарға алынуы тиіс.

3. Тұжырымдама осы Ережелердің 2 қосымшасына сәйкес ресімделеді.
4. Биржаның тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесінің басшысы (ол болмаған жағдайда – маман) қол қойған тұжырымдаманы Инвестициялық комитет тің хатшысына беріледі.

Тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімше Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысын (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерді) тұжырымдама беру туралы ауызша хабардар етеді.

## 9 бап.

### Инвестициялық шешім қабылдау

1. Инвестициялық комитет тің хатшысы Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті мен тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің басшысынан (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерден) алған ұсыным мен қорытынды осы құжаттардың осы Ережелердің 7 бабының 7 тармағында және 8 бабының 5 тармағында белгіленген талаптарға сәйкестігін тексеруге жатады.

Егер Ұсынымды, Тұжырымдаманы және Инвестициялық шешімнің жобасын Инвестициялық комитет тің хатшысы Алматы уақытымен 13.00-ге дейін алса, ол аталған тексеруді ағымдағы жұмыс күні аяқталғанға дейін аяқтауға міндетті.

Егер Ұсынымды, Тұжырымдаманы және Инвестициялық шешімнің жобасын Инвестициялық комитет тің хатшысы Алматы уақытымен 13.00-ден кейін алса, ол аталған тексеруді осы құжаттарды алған күннен кейінгі бірінші жұмыс күні Алматы уақытымен 13.00-ге дейін аяқтауға міндетті.

Ұсынымды және/немесе Тұжырымдаманы және/немесе Инвестициялық шешімнің жобасын ресімдеуге ескертулер болған кезде Инвестициялық комитет тің хатшысы оны (оларды) Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерге) және/немесе тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге пысықтауға қайтарады.

Ұсынымды, Тұжырымдаманы және Инвестициялық шешімнің жобасын ресімдеуге ескертулер болмаған кезде Инвестициялық комитет тің хатшысы Инвестициялық комитет тің отырысын шақыру туралы шешім қабылдау мақсатында бұл құжаттарды Инвестициялық комитет тің төрағасына немесе Инвестициялық комитет төрағасының орынбасарына береді.

2. Инвестициялық комитет Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен бір мәмілеге де, осындай бірнеше мәмілеге де қатысты Инвестициялық шешім қабылдауға құқылы. Биржа хеджирлеу құралдарын да пайдалануға құқылы. Хеджирлеу құралдарымен мәміле жасасу үшін Инвестициялық шешім осы Ережелердің 3 қосымшасында көрсетілген мәліметтерден басқа мыналарды қамтиды:
  - 1) хеджирлеу құралының түрін, оны жасасу мерзімін, көлемін, құнын (сыйлықақысын), хеджирлеу операциясын жасау жоспарланып отырған нарықты және осы құралдың басқа да сипаттамаларын (шарттарын) көрсете отырып, егжей-тегжейлі сипаттамасы;
  - 2) осы хеджирлеу құралын қолданудан күтілетін нәтижелер;
  - 3) хеджирлеу объектісінің (базистік активтің) тәуекелін оның түрін (пайыздық, бағалық, валюталық және өзге), сондай-ақ оны бағалау әдісін көрсете отырып бағалау;

- 4) қажетті деректемелерді (ұлттық сәйкестендіру нөмірі, саны, құны, көлемі, валютасы) көрсете отырып, хеджирлеу объектісінің сипаттамасы;
  - 5) осы операцияны жасау хеджирлеу объектісі бойынша ықтимал залалдар мөлшерінің төмендеуіне (табыстың толық алынбауына) әкелетінін растайтын есеп-қисап.
3. Инвестициялық комитет тің Ұсыным немесе Тұжырымдама болмаған кезде, сондай-ақ Ұсынымнан ауытқып (осы баптың 4 тармағында белгіленген ерекшеліктерді қоспағанда) Инвестициялық шешім қабылдауға құқығы жоқ.
- Инвестициялық комитет ұсынымда көрсетілген мәмілелерге қатысты Инвестициялық шешім қабылдамауға құқылы.
4. Инвестициялық комитет мынадай жағдайларда ұсынымнан ауытқи отырып, Инвестициялық шешім қабылдауға құқылы:
- 1) Инвестициялық шешім Ұсынымда көрсетілген кейбір мәмілелерге ғана қатысты қабылданды;
  - 2) Инвестициялық шешімде көрсетілген мәміленің/мәмілелердің көлемі Ұсынымда көрсетілген мәміленің/мәмілелердің көлеміне қатысты аз болып табылады;
  - 3) Инвестициялық шешімде көрсетілген қаржы құралдарын сатып алу бағасы ұсынымда көрсетілген оларды сатып алудың минималды бағасына қарағанда аз болып табылады (Инвестициялық шешімде көрсетілген қаржы құралы кірістілігінің мөлшерлемесі (қаржы құралы бойынша сыйақы мөлшерлемесі) ұсынымда көрсетілген кірістіліктің (сыйақының) максималды мөлшерлемесіне қатысты үлкен болып табылады);
  - 4) Инвестициялық шешімде көрсетілген қаржы құралдарын сату бағасы Ұсынымда көрсетілген оларды сатудың максималды бағасына қатысты үлкен болып табылады.
5. Осы Ережелердің 3 қосымшасының нысаны бойынша жасалған және Инвестициялық комитет отырысының қорытындылары бойынша қабылданған қаржы құралдарымен мәміле жасасуға арналған Инвестициялық шешімде мыналар болуы тиіс:
- 1) инвестициялық шешімнің қабылданған күні және нөмірі;
  - 2) негізінде Инвестициялық шешім қабылданған ұсынымның берілген күні мен нөмірі;
  - 3) жасалуға жататын/жасалатын мәміленің түрі/мәмілелердің түрлері;
  - 4) мәміле жасалуы/мәмілелер жасалуы тиіс қаржы құралының сәйкестендіргіші;
  - 5) жасалуға жататын/жасалатын мәміленің/мәмілелердің көлемі, бағасы (кірістілігі) және сомасы (көлем ауқымы, бағасы (кірістілігі) және сомасы);
  - 6) мәміле жасау мерзімдері;
  - 7) мәміле жасасу болжанатын нарық түріне (бастапқы немесе қайталама, ұйымдастырылған немесе ұйымдастырылмаған, халықаралық нарықтар) нұсқау;
  - 8) оның көмегімен мәміле/мәмілелер жасасу көзделетін делдалдың (брокердің) атауы (ол болған кезде);
  - 9) Инвестициялық комитет мүшелерінің қайсыбірінің Инвестициялық шешім қабылдауға (қабылдамауға) қатысты ерекше пікірінің болуын

көрсету; Инвестициялық шешім қабылдаған адамдардың атқаратын лауазымдары көрсетіле отырып, олардың қолдары.

- Егер Инвестициялық шешімді орындау үшін жасалуы тиісті қаржы құралдарымен жасалған мәміле ірі мәміле немесе Биржа оны жасауға мүдделілік білдірген мәміле болып табылса, осы Инвестициялық шешімде осы мәмілені жасасу туралы Биржаның Директорлар кеңесінің шешім қабылдау қажеттігі туралы белгі де болуы тиіс.
- Қабылданған Инвестициялық шешім осы Ережелердің 3 қосымшасына сәйкес екі данада ресімделеді.

Инвестициялық шешімге Инвестициялық шешімді қабылдауға дауыс берген Инвестициялық комитет мүшелері қол қояды.

Инвестициялық комитет тің мүшесі Инвестициялық шешім қабылдауға қарсы дауыс берсе, Инвестициялық комитет тің хатшысы Инвестициялық комитет тің әрбір мүшесінің пікірін және қабылданған шешімнің негіздемесін Инвестициялық комитет тің осы мүшесінің қол қоюына арналған Инвестициялық шешім жолында тіркейді.

Инвестициялық комитет мүшесі Инвестициялық шешімге қатысты ерекше пікір білдірсе, Инвестициялық комитет тің хатшысы Инвестициялық комитет тің осы мүшесінің қол қоюына арналған Инвестициялық шешім жолына "отырыс хаттамасындағы ерекше пікірді қараңыз" деген белгі қояды.

## 10 бап.

### Инвестициялық шешімді орындау

- Инвестициялық шешіммен белгіленген операцияны жүзеге асыру күнінен және/немесе уақытынан кешіктірмей Инвестициялық комитет тің хатшысы қабылданған Инвестициялық шешімнің бір данасын Биржаның Бухгалтериясына, ал корреспонденттік шоттар бойынша аудару кезінде Биржаның есеп айырысу бөлімшесіне орындауға береді (*осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен өзгертілген*).

Инвестициялық комитет тің хатшысынан Инвестициялық комитет тің Инвестициялық шешімінің / Инвестициялық шешімдерінің үзіндісін алғаннан кейін Бухгалтерияға орындауға аудару кезінде Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) Инвестициялық шешімді/төлем өтінімін орындау кезінде туындайтын банк комиссияларын ескере отырып, инвестициялау сомасын қамтитын төлемдерді жүзеге асыру тәртібінің нысанына сәйкес төлемге өтінім/өтінімдер беруі тиіс.

Есеп айырысу бөлімшесі Инвестициялық шешім негізінде Инвестициялық шешімді орындау шеңберінде операцияларды одан әрі жүргізу үшін Биржаның корреспонденттік шотынан/корреспонденттік шоттарынан Биржаның банктік шотына ақша аударуды жүзеге асырады.

Қабылданған Инвестициялық шешімнің екінші данасын Инвестициялық шешім қабылданған Инвестициялық комитет отырысының хаттамасымен бірге Инвестициялық комитет тің хатшысы сақтауы тиіс.

Сұрау салынған жағдайда, Инвестициялық комитет тің хатшысы қабылданған Инвестициялық шешімнің көшірмелерін кейіннен бақылауды жүзеге асыру үшін Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (ол болмаған жағдайда – оның міндетін атқарушы қызметкерге) және тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге береді.

- Инвестициялық шешімді орындау шеңберінде мәміле жасау үшін Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) тиісті клиенттік тапсырысты және/немесе тиісті клиенттік тапсырыстарды ресімдейді; Биржа

бухгалтериясы – тиісті төлем тапсырмасының және/немесе төлем тапсырмасының түпнұсқасы.

Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің), Биржа бухгалтериясының клиенттік тапсырысты және/немесе төлем тапсырмасын ресімдеуге құқығы жоқ, ал Бухгалтерияның тиісті Инвестициялық шешім болмаған кезде, сондай-ақ одан ауытқып аударымды/аударымдарды жүзеге асыруға құқығы жоқ.

3. Клиенттік тапсырысты және/немесе төлем тапсырмасын Инвестициялық шешімді орындау үшін ресімдеу тиісті келісім-шартты (мысалы, банктік салым келісім-шартын) алдын ала жасасуды талап еткен жағдайда, Инвестициялық комитет тің, Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер Биржаның Заң бөлімімен бірлесіп осындай шарт жасасу жөніндегі іс-шараларды жүзеге асырады. Бұл ретте мұндай келісім-шарттың талаптары (нысаны) Инвестициялық комитет мүшелерімен осы келісім-шарттың (осы нысанның) Инвестициялық шешімге және Биржаның мүдделеріне сәйкестігі тұрғысынан келісуге жатады.
4. Инвестициялық комитет тің, Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер ресімдеген клиенттік тапсырысқа, сондай-ақ Биржаның Бухгалтериясымен ресімделген төлем тапсырмасына клиенттік тапсырыстарға және/немесе төлем тапсырмаларына қол қоюға уәкілетті лауазымды тұлғалар болып табылатын Биржа қызметкерлері қол қоюға жатады және Биржа брокеріне (банкіне) орындауға беріледі.
5. Клиенттік тапсырысты орындағаннан кейін Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) клиенттік тапсырыстың орындалуын бақылау мақсатында клиенттік тапсырыстың орындалған күні Биржа брокерінен жасалған мәміле бойынша есепті (ашылу күні мен жабылу күні көрсетілген меншікті авторепо мәмілесі бойынша онлайн-есепті немесе бағалы қағаздарды сатып алу / сату туралы мәміле/ орындалған операциялар бойынша есепті) талап етуге және алуға міндетті., бухгалтерлік есепте көрсету үшін брокерден Бухгалтерияға алған күннен кешіктірмей есептің түпнұсқасын/көшірмесін, ал осы есептің көшірмесін Инвестициялық комитет тің хатшысына ұсыну қажет.

Төлем тапсырмасын орындағаннан кейін Биржа Бухгалтериясы банктен осы төлем тапсырмасына сәйкес жүзеге асырылған операция бойынша шоттан үзінді көшірмені талап етуге және алуға міндетті.

Инвестициялық шешімді орындау үшін Биржаның корреспонденттік шотынан/корреспонденттік шоттарынан ақша аударуды жүзеге асырғаннан кейін Биржаның есеп айырысу бөлімшесі Биржаның Бухгалтериясына, Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (не Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерге) және Инвестициялық комитет тің хатшысына корреспонденттік шоттан/корреспонденттік шоттардан ақшаның есептен шығарылғанын растайтын құжаттарды ұсынуы тиіс.

6. Клиенттік тапсырысты орындау және клиенттік тапсырысқа сәйкес жасалған мәміле туралы есепті алу тәртібіне қатысты Биржаның өз брокерімен өзара іс-қимылын Биржа мен осы Брокер арасында жасалған брокерлік қызметтерді көрсету туралы шартқа сәйкес Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) жүзеге асырады.

Биржаның төлем тапсырмасын орындау және төлем тапсырмасына сәйкес жүзеге асырылған операция бойынша шоттан үзінді көшірме алу тәртібіне қатысты Биржаның банкпен өзара іс-қимылын Биржа мен осы банк арасында жасалған банктік шот шартына сәйкес Биржа Бухгалтериясы жүзеге асырады.

7. Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді есепке алуды Қазақстан Республикасының бухгалтерлік есеп пен қаржылық есеп берушілік туралы заңнамасына, Халықаралық қаржылық есеп берушілік стандарттарына және Биржаның "Есепке алу саясаты"<sup>1</sup> атты ішкі құжатына сәйкес Биржа Бухгалтериясы жүзеге асырады.

#### **4 тарау. БИРЖА АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛАУҒА ҚАТЫСТЫ ӨЗГЕ ДЕ ҚАҒИДАЛАР**

##### **11 бап.**

##### **Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің жай-күйін талдау және меншікті активтер есебінен жасалған қаржы құралдарымен операциялар бойынша қызметтің нәтижелері туралы есеп берушілікті жіберу**

1. Биржа Бухгалтериясы ай сайын Биржа брокерімен және Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерімен Биржа активтері инвестицияланған мерзімді салымдарға осы брокерде ашылған (ашылған) Биржаның шотындағы (шоттарындағы) және осы банктердегі Биржа салымдарындағы соңғы өткен айдағы қаржы құралдары мен ақшаның қалдықтары мен қозғалысын салыстырып тексеруді жүзеге асырады.
2. Күн сайынғы негізде Биржа Бухгалтериясы Биржаның ағымдағы шоттарындағы қалдықтар бойынша мәліметтерді және әрбір мәміле бойынша брокердің есептері болған кезде Биржаның инвестициялық портфельдерінің қаржы құралдары бойынша қалдықтарды, ал Биржаның есеп айырысу бөлімшесі корреспонденттік шоттардағы қалдықтарды Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерге) ұсынады.
3. Ай сайынғы негізде Биржа Бухгалтериясы есепті айдан кейінгі төртінші жұмыс күнінен кешіктірмей Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкерге) және тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге Биржаның инвестициялық портфельдерінің қаржы құралдары бойынша қалдықтары мен қозғалысы туралы мәліметтерді ұсынады.
4. Осы баптың 3 тармағында көрсетілген мәліметтерді алған күннен бастап бір жұмыс күні ішінде Инвестициялық комитет тің, Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер:
  - 1) осы Ережелердің 4 қосымшаның нысаны бойынша соңғы өткен айдағы инвестициялық портфельдер бөлігінде Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер туралы есеп;
  - 2) осы Ережелердің 5 қосымшасының нысаны бойынша ағымдағы айдың бірінші күніндегі жағдай бойынша Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің құрамы мен құрылымы туралы мәліметтер.
5. Осы баптың 4 тармағында көрсетілген деректерді қалыптастырғаннан кейін екі жұмыс күні ішінде Инвестициялық комитет тің, Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер:
  - 1) осы баптың 4 тармағына сәйкес қалыптастырылған есеп пен мәліметтерді – Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысына (келісу үшін) және Биржа бухгалтериясына (тексеру үшін);

---

<sup>1</sup> Есепке алу саясаты "Қазақстан қор биржасы" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен (2016 жылдың 09 желтоқсанындағы № 40 отырыс хаттамасы) бекітілген.

- 2) осы баптың 4 тармағының 1) тармақшасына сәйкес қалыптастырылған есепті – Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге (тексеру және келісу үшін) ұсынады.
6. Биржа Бухгалтериясынан осы баптың 2 тармағында көрсетілген мәліметтерді алған күннен бастап жеті жұмыс күні ішінде Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер):
  - 1) осы Ережелердің 7 бабының 3 және 4 тармақтарында белгіленгенге ұқсас тәртіппен Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің жай-күйіне (Биржа активтерін инвестициялау нәтижелеріне) талдау жүргізеді;
  - 2) көрсетілген талдау нәтижелері бойынша түсіндірме жазба жасайды;
  - 3) аталған түсіндірме жазбаны, сондай-ақ осы баптың 4 тармағына сәйкес қалыптастырылған есеп пен мәліметтерді Инвестициялық комитет тің хатшысына береді.
7. Осы баптың 6 тармағына сәйкес құжаттарды алғаннан кейін Инвестициялық комитет тің хатшысы бұл құжаттарды Инвестициялық комитет тің төрағасына немесе Инвестициялық комитет төрағасының орынбасарына Биржа активтерінің инвестициялық портфельдерінің жай-күйін талдау нәтижелерін (Биржа активтерін инвестициялау нәтижелерін) қарау үшін Инвестициялық комитет тің отырысын шақыру туралы шешім қабылдау мақсатында ұсынады.
8. Осы баптың 6 тармағына сәйкес Инвестициялық комитет тің хатшысы алған құжаттар Инвестициялық комитет отырыстарының күн тәртібі мәселелері жөніндегі материалдардың бақылау даналары сияқты сақталуға тиіс.
9. Бухгалтерия Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2019 жылдың 26 қарашасындағы "Меншікті активтерді инвестициялау бойынша жасалған мәмілелер туралы есеп" № 211 қаулысының 51 қосымшасына сәйкес ай сайын есепті айдан кейінгі бесінші жұмыс күнінен кешіктірмей өз активтері есебінен жасалған қаржы құралдарымен операциялар бойынша қызметтің нәтижелері туралы есеп берушілікті қалыптастырады және Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне ұсынады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 02 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілген)*.

**12 бап.**

**Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдары бойынша дефолт ықтималдығын анықтау**

1. *(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен өзгертілген және 2020 жылдың 02 желтоқсанындағы Биржаның Директорлар кеңесінің шешімімен алынып тасталған)*.
2. Инвестициялық портфельдердің құрамына кіретін қаржы құралдары бойынша дефолт ықтималдығын Биржа Басқармасы бекіткен әдістемеге сәйкес тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімше анықтайды (осы тармақтың екінші абзацында және осы баптың 3 тармағында белгіленген ерекшеліктерді ескере отырып) *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 02 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілген)*.

Дефолт ықтималдығын анықтау үшін сандық (өлшенетін) және сапалық көрсеткіштер қолданылады.
3. Дефолт ықтималдығы пайызбен "мән неғұрлым үлкен болса, ықтималдық соғұрлым жоғары болады" қағидаты бойынша үтірден кейін екінші таңбаға дейінгі дәлдікпен көрсетіледі, ал дефолт ықтималдығын сипаттайтын көрсеткіш эмитенттің (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі

банкiнiң) үш деңгейлi шәкiл бойынша берiлетiн кредитке қабiлеттiлiктiң iшкi рейтингi болып табылады:

- 1) I деңгей ("дефолттың төмен ықтималдығы") – дефолт ықтималдығының мәні 25 %-дан кем болғанда;
  - 2) II деңгей ("дефолттың орташа ықтималдығы") – дефолт ықтималдығының мәні 25 %-дан кем емес, бiрақ 50 %-дан кем болғанда;
  - 3) III деңгей ("дефолттың жоғары ықтималдығы, дефолт алдыңғы жағдай") – дефолт ықтималдығының мәні 50 %-дан кем емес, бiрақ 100 %-дан кем болғанда.
4. Биржа тәуекелдерiн басқаруды жүзеге асыратын бөлiмше ай сайын айдың 20 жұмыс күнiнен кешiктiрмей Инвестициялық комитет тiң қарауына осы айдың басындағы жағдай бойынша жасалған дефолт ықтималдығын анықтау нәтижелерi туралы есептi бередi.

**13 бап.**

**Биржаның инвестициялық портфельдерiнiң құрамына кiретiн қаржы құралдары бойынша дефолт ықтималдығына байланысты шаралар**

1. Эмитентке (Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкiне) I деңгейдегi кредитке қабiлеттiлiктiң iшкi рейтингiн берген кезде Биржа осы эмитентке (банкке) қатысты қандай да бiр шаралар қолданбайды.
2. Эмитентке II деңгейдегi кредитке қабiлеттiлiктiң iшкi рейтингiн берген кезде Инвестициялық комитет осы эмитент шығарған қаржы құралдарын сатудың орындылығын бағалайды және осындай орындылығы болған кезде сату мақсатында шаралар қабылдайды.  

Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкiне II деңгейдегi кредитке қабiлеттiлiктiң iшкi рейтингiн берген кезде Инвестициялық комитет Биржа активтерi инвестицияланған осы банктегi мерзiмдi салымдардың мөлшерiн азайтудың немесе осы салымдардың шарттарын қайта қараудың орындылығын бағалайды және осындай орындылығы болған кезде осындай азайту немесе қайта қарау мақсатында шаралар қабылдайды.
3. Эмитентке (Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкiне) III деңгейдегi кредитке қабiлеттiлiктiң iшкi рейтингiн берген кезде Инвестициялық комитет осы эмитент шығарған қаржы құралдары бойынша әлеуеттi дефолттан (осы банктiң әлеуеттi дефолтынан) ықтимал шығындарды азайту жөнiнде шаралар қабылдайды.

**14 бап.**

**Биржаның инвестициялық портфельдерiнiң құрамына кiретiн қаржы құралдары бойынша техникалық дефолтқа және дефолтқа байланысты шаралар**

1. Осы Ережелердiң мақсаттары үшiн техникалық дефолт деп эмитенттiң (Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкiнiң) кредиторлар (депозиторлар) алдындағы мiндеттемелерiн орындауы мүмкiн болған кезде мiндеттемелерiн орындамауы немесе эмитенттiң (Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкiнiң) эмиссиялық бағалы қағаздардың шығарылым аңдатпасының талаптарына сәйкес осындай бұзушылық болуы шартымен келiсiм-шарттық мiндеттемелердi бұзуына жол беруi түсiнiледi, Биржа мен эмитент (Қазақстан Республикасының екiншi деңгейдегi банкi) арасындағы шарттық мiндеттемелер немесе Қазақстан Республикасы заңнамасының талаптарына сәйкес дефолт деп танылмайды.
2. Биржаның iшкi мақсаттары үшiн Инвестициялық комитет техникалық дефолт ретiнде анықталған жағдайдың туындауын, сондай-ақ техникалық

дефолттың ұзақтығы асып кеткен кезде өте маңызды деп саналатын мерзімді анықтайды.

3. Техникалық дефолт туындаған кезде Инвестициялық комитет осы эмитент (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкі) шығарған қаржы құралдары бойынша ықтимал дефолттан болатын ықтимал шығындарды азайту жөнінде мынадай шаралар қабылдайды:
  - 1) техникалық дефолттың туындау себептерін анықтайды;
  - 2) Заң бөлімінің жәрдемдесуімен эмитентпен (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі Банкімен) өзара қарым-қатынастарды соттан тыс тәртіппен реттеу үшін кездесулер, келіссөздер, хат алмасу және басқа да іс-әрекеттер ұйымдастырады.
4. Осы баптың 2 тармағында көрсетілген мерзім асып кеткен жағдайда Биржаның эмитенттен (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі Банкінен) Қазақстан Республикасының заңнамасына және Биржа мен эмитент (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкі) арасындағы келісім-шарттық қатынастарға сәйкес өзінің барлық міндеттемелерінің орындалуын талап етуге құқығы бар.
5. Дефолт туындаған жағдайда Инвестициялық комитет келесі туралы шешім қабылдайды:
  - 1) мерзімі өткен берешекпен жұмысты реттейтін Биржаның ішкі құжатының талаптарына сәйкес оларды іске асыру шаралары мен мерзімдерін қолдану туралы, және/немесе;
  - 2) Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес берешекті өндіріп алу үшін Инвестициялық комитет тің хатшысы борышкер бойынша қалыптастырған досьені Биржаның Заң бөліміне беру туралы.
6. Эмитентті (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкі) қайта құрылымдау жүзеге асырылған жағдайда Инвестициялық комитет Биржа Басқармасының қарауына және бекітуіне осындай эмитентке (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіне) қатысты қолданылуға жататын шараларды енгізеді.
7. Мерзімі өткен берешек бойынша жұмысты реттейтін Биржаның ішкі құжатына сәйкес, эмитентке (Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіне) қатысты Заң бөлімі жүргізетін жұмысты орындау жөніндегі ақпарат Инвестициялық комитет тің қарауы үшін осы Ережелердің 11 бабы 2 тармағының 2) тармақшасына сәйкес жасалатын түсіндірме жазбаға енгізілуі тиіс.

**15 бап.**

**Инвестициялау саясатына өзгертулер мен толықтырулар жобаларын немесе оның жаңа редакциядағы жобаларын әзірлеу**

1. Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу немесе оны жаңа редакцияда бекіту жөніндегі ұсынымдарды Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) немесе тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімше әзірлейді, бұл ретте:
  - 1) Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) (қажет болған жағдайда) осы Қағидалардың 7 бабына сәйкес жүргізілген талдау нәтижелері бойынша Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу немесе оны жаңа редакцияда бекіту жөнінде, сондай-ақ Биржаның активтерін инвестициялау мақсатын, және/немесе стратегиясын және/немесе объектілерін өзгерту мақсатқа сай болған жағдайда (Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының пікірі бойынша) ұсыным әзірлейді;

- 2) Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің басшысы осы Ережелердің 11 бабына сәйкес жүргізілген талдау нәтижелері бойынша, сондай-ақ Биржа активтерін инвестициялау шектелімдерін және/немесе шарттарын және/немесе шектеулерін өзгерту мақсатқа сай болған жағдайда (Биржа тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімше басшысының пікірі бойынша) Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу немесе оны жаңа редакцияда бекіту жөнінде (қажет болған кезде) ұсыным әзірлейді.
2. Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті немесе Биржаның тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесі басшысының (не Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу немесе оны жаңа редакцияда бекіту жөніндегі ұсынымы:
  - 1) осындай өзгертулерді және/немесе толықтыруларды (инвестициялау саясатының жаңа редакциясын) әзірлеудің талдамалық негіздемесін және осындай өзгертулерді және/немесе толықтыруларды (инвестициялау саясатының жаңа редакциясын бекітуді) бекітудің күтілетін салдарларының сипаттамасын қамтуы тиіс;
  - 2) осындай өзгертулер және/немесе толықтырулар жобасы (жаңа редакциядағы Инвестициялау саясатының жобасы) қоса берілуі тиіс;
  - 3) (егер осы ұсыным Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу мақсатында әзірленген жағдайда) осындай өзгертулердің және/немесе толықтырулардың жобасына салыстырмалы кестемен сүйемелденуі тиіс;
  - 4) Инвестициялық комитет тің хатшысына берілуі тиіс.
3. Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті немесе Биржаның тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесі басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар енгізу немесе оны жаңа редакцияда бекіту жөніндегі ұсынымын алғаннан кейін Инвестициялық комитет тің хатшысы осы ұсынымды Инвестициялық комитет тің төрағасына ұсынады, Инвестициялық саясатқа өзгертулер және/немесе толықтырулар жобасын (жаңа редакциядағы Инвестициялау саясатының жобасын) келісу үшін Инвестициялық комитет тің отырысын шақырады.
4. Инвестициялық комитет тің шешімімен келісілген Инвестициялау саясатына өзгертулер және/немесе толықтырулар жобасы (жаңа редакциядағы Инвестициялау саясатының жобасы) Биржаның Заң бөліміне (осы жобаның Қазақстан Республикасының заңнамасына және заң техникасының нормаларына сәйкестігі бөлігінде) және Биржаның басқа бөлімшелеріне (Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес) келісуге берілуі тиіс.
5. Биржаның Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкер) немесе Биржаның тәуекелдерін басқаруды жүзеге асыратын бөлімше Инвестициялау саясатына өзгертулердің және/немесе толықтырулардың жобасын (жаңа редакциядағы Инвестициялау саясатының жобасын) осы баптың 2 тармағында көрсетілген ұсынымды қоса бере отырып, ішкі құжаттарға сәйкес Биржа органдарының қарауына/ бекітуіне береді.

#### 16 бап.

#### Қаржы құралдарына қатысты Биржаның ниеттерін анықтау

1. Инвестициялық комитет Биржаның оның барлық немесе жекелеген инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдарына қатысты ниетін анықтайды "келісім-шартта көзделген ақша қаражатының ағындарын алу үшін активті ұстап қалу мақсаттары үшін және осы қаржы

активі келісім-шартының талаптары бойынша көрсетілген ағындар тек қана негізгі борыш пен пайыздардың төленуін білдіреді", немесе "келісім-шартта көзделген ақша қаражатының ағындарын алу, сондай-ақ қаржы активтерін сату мақсаттары үшін", немесе "келісім-шартта көзделген ақша қаражатының ағындарын алу мақсатында емес (пайда мен шығын арқылы әділ құны бойынша бағаланатын) ұстап қалудың әділ құнының өзгертулерін іске асыру үшін сауда мақсаттары үшін".

2. Инвестициялық комитет Биржаның Инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдарына қатысты Биржаның ниетін осы Қағидалардың 7 бабына сәйкес жүргізілген талдау нәтижелері бойынша өзі (қажет болған жағдайда) әзірлейтін Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитет тің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) жекелеген ұсынымдары негізінде анықтайды.
3. Инвестициялық комитет белгілеген Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қандай да бір атаудың қаржы құралдарына қатысты ниеті Инвестициялық комитет тің инвестициялық шешімінде көрсетіледі, оның түпнұсқасын Биржа бухгалтериясы Инвестициялық комитет інің хатшысы орындау үшін береді.

Биржа Бухгалтериясы Инвестициялық комитет тің инвестициялық шешімінде көрсетілген осы атаудың қаржы құралдарына қатысты Биржаның ниетіне сәйкес Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қандай да бір атаудың қаржы құралдарын Биржаның бухгалтерлік есебінде жіктейді.

#### 17 бап.

#### Биржаның Директорлар кеңесіне арналған ақпарат

1. Тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі күнтізбелік тоқсанда кемінде бір рет Биржаның Директорлар кеңесінің Ішкі аудит жөніндегі комитетінің және Биржаның Директорлар кеңесінің қарауына меншікті портфелінің/клирингілік қорлар портфелінің/клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелінің (Биржа активтерін инвестициялау нәтижелерінің) және Биржаның осы инвестициялық портфельдерінің тәуекелдерге ұшырауының жағдайын талдау нәтижелері бойынша қорытынды (бұдан әрі – осы бапта – "тоқсан сайынғы баяндама") береді *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен өзгертілген)*.

Тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеге жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі тоқсан сайынғы баяндаманы берумен бір мезгілде Ішкі аудит жөніндегі Биржаның Директорлар кеңесінің комитетінің және Биржа Директорлар кеңесінің қарауына тоқсан сайынғы баяндама сияқты сол күнгі жағдай бойынша жасалған, Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдары бойынша дефолт ықтималдығын анықтау нәтижелері туралы есепті береді *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен өзгертілген)*.

2. Тоқсан сайынғы баяндаманы жасау кезінде зерделенеді:
  - 1) Биржаның активтер бойынша өтімділікті жоғалту тәуекеліне ұшырауы;
  - 2) тәуекелді бағалау моделі және осы қаржы құралдарының ағымдағы бағаларын нарықтық бағаларға келтіру негізінде Биржаның инвестициялық портфельдерінің құрамына кіретін қаржы құралдарының құнын бағалау.

Қаржы құралдарының құнын есептеу келесілердің негізінде іске асырылады:

- Биржаның ресми интернет-ресурсында орналастырылған және бағалы қағаздарды бағалау әдістемесіне сәйкес есептелген бағалы қағаздарды және өзге де қаржы құралдарын нарықтық бағалау деректері;
- Биржаның ресми интернет-ресурсында орналастырылған және өтімді емес борыштық бағалы қағаздар кірістілігінің орташа өлшемді мөлшерлемесін есептеу және олардың әділ құнын анықтау әдістемесіне сәйкес есептелген бағалы қағаздарды және бағалы қағаздардың ұйымдастырылған нарығында айналысқа түспейтін өзге де қаржы құралдарын нарықтық бағалау деректері;

*(Осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2020 жылдың 13 сәуіріндегі шешімімен өзгертілген)*

- 3) осы баптың 3 тармағына сәйкес Биржаның инвестициялық портфельдерін бэк-тестілеу жолымен тәуекелдерді өлшеу процедураларының тиімділігі.
3. Биржаның инвестициялық портфельдерін стресс-тестілеу № 252 Ережелердің 2 қосымшасының нысандары бойынша орындалады.  
Биржаның инвестициялық портфельдерін бэк-тестілеу Биржа активтерін инвестициялаудың тарихи деректері, Биржаның инвестициялық портфельдерін стресс-тестілеу нәтижелері және Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен жасалған мәмілелердің ағымдағы (нақты) нәтижелері бойынша орындалады.  
Резидент емес банктер бойынша стресс-тестілеу және бэк-тестілеу жүзеге асырылмайды.
4. Тоқсан сайынғы баяндамаға тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің басшысы (не оның орнындағы адам) және осы бөлімшеге жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі қол қояды.

**18 бап. Тұжырымды қағидалар**

1. Мәміле шарттары осы Ережелердің және Инвестициялау саясатының талаптарына сәйкес келмеген жағдайда, осындай мәміле жасау туралы шешімді Биржаның Директорлар кеңесі мақұлдауы тиіс.
2. Осы Активтер ережелерінің талаптарын орындау үшін жауапкершілік Инвестициялық комитетке жүктеледі.
3. Осы Ережелерге енгізілетін өзгертулер және/немесе толықтыруларды (өзектілендіру) уақтылы енгізу үшін жауапкершілік Қаржы-әкімшілік департаментіне жүктеледі. Осы Ережелер қажеттілігіне қарай, бірақ үш жылда бір реттен сиретпей өзектілендіруге жатады.

Активтерді инвестициялау  
ережелеріне

**1 қосымша**

**XXXX жылдың XX айындағы № X**

**Ұ С Ы Н Ы М**

- Биржаның меншікті портфелі бойынша
- клирингтік қорлардың портфелі бойынша
- клирингтік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі бойынша

**Ұсыным беру үшін пайдаланылған ақпарат көздерінің тізбесі (сипаттамасы):**

- \_\_\_\_\_ ;
- \_\_\_\_\_ ;

**Ұсыным беру үшін пайдаланылған ақпаратты талдау нәтижелері:**

- ұсынылатын мәмілелердің инвестициялық портфель кірістілігінің өзгеруіне әсері: \_\_\_\_\_ ;
- ұсынылатын мәмілелер заттары – қаржы құралдарымен байланысты тәуекелдер: \_\_\_\_\_ ;
- ұсынылатын мәмілелердің пруденциялық нормативтерге әсері: \_\_\_\_\_ ;
- активтерді инвестициялау саясатына сәйкес жасауға ұсынылатын мәмілені жасасу мақсаты: \_\_\_\_\_ ;
- өзгесі [атап кету]: \_\_\_\_\_ .

**Қаржы құралдарының сипаттамасы:**

№ р/с	Қаржы құралының атауы <sup>1</sup>	Валюта <sup>2</sup>	Мәміле көлемінің диапазоны <sup>3</sup>	Баға / табыстылық мөлшерлемелері (сыйақы) диапазоны <sup>4</sup>	Мәміле сомасының диапазоны	Қосымша шарттар мен шектеулер
1.						
2.						
3.						

<sup>1</sup> Биржаның активтерін инвестициялау (инвестицияланған) ұсынылатын мерзімді салымға Қазақстан Республикасының қаржы құралы эмитентінің немесе екінші деңгейдегі банктің атауын қоса алғанда.

<sup>2</sup> ISO 4217 Халықаралық стандартына сәйкес қаржы құралының номиналдық құнын деноминациялау валютасының алфавиттік коды.

<sup>3</sup> Қаржы құралының өлшем бірлігімен (егер қаржы құралы – ұсынылатын мәміленің заты Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіндегі мерзімді салым болып табылған жағдайда толтырылмайды).

<sup>4</sup> Қаржы құралының өлшем бірлігі үшін.

**Ұсынылатын мәмілелерді жасау мақсаты:**

- меншікті активтердің/клирингілік қорлардың сақталуы мен өтімділігін және клирингілік қатысушылар ақшасының сақталуын қамтамасыз ету
- биржалық нарықтың тиісті клирингілік қор секторларындағы операциялар бойынша адал клирингілік қатысушының талаптарын уақтылы жабуды қамтамасыз ету
- клирингілік қатысушылардың ақшасын уақтылы қайтаруды қамтамасыз ету
- жеке/клирингілік қорлардың/клирингілік қатысушылардың портфелі үшін бекітілген стратегия шеңберінде инвестициялық табыстың оңтайлы деңгейін қамтамасыз ету
- инвестициялық портфельді активтерді инвестициялау саясатына сәйкес келтіру
- басқа мақсат [нақты не екенін көрсету]

**Ұсынылатын мәмілелерді жасау мақсаттарына түсініктеме:**

---

---

**Инвестициялық шешімнің ұсынылатын нұсқалары:**

1. (1-нұсқа бойынша шешім жобасы жазылуы тиіс).
2. (2-нұсқа бойынша шешім жобасы жазылуы тиіс).
- N. (n-нұсқа бойынша шешім жобасы жазылуы тиіс).

[ұсыным берген тұлғаның  
лауазымы]

[қолы]

Инициалдары, тегі

Активтерді инвестициялау  
ережелеріне

**2 қосымша**

**XXXX жылдың XX айындағы № X  
ҰСЫНЫМ БОЙЫНША ТҰЖЫРЫМДАМА**

- Биржаның меншікті портфелі бойынша
- клирингілік қорлардың портфелі бойынша
- клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі бойынша

**Ұсынылатын мәмілелердің Активтерді инвестициялау саясатына сәйкестігіне әсері:**

---

---

**Ұсынылатын мәмілелердің заты – қаржы құралдары бойынша тәуекелдер:**

---

---

**Басқа пікірлер:**

---

---

[лауазымы]

[қолы]

Инициалдары, тегі

## "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

### № X ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ШЕШІМ

- Биржаның меншікті портфелі бойынша
- клирингтік қорлардың портфелі бойынша
- клирингтік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі бойынша

Осы шешім "Қазақстан қор биржасы" АҚ инвестициялық комитетінің (бұдан әрі – Биржа) отырысында (XXXX жылдың XX айындағы № X отырысының хаттамасы) Биржаның Қаржы-әкімшілік департаменті басшысының (немесе Инвестициялық комитеттің шешіміне сәйкес анықталған қызметкердің) XXXX жылдың XX айындағы № X ұсынымы негізінде қабылданды және көрсетілген отырыстың хаттамасымен бірге сақталуы тиіс.

Осы шешімге сәйкес Биржа активтері есебінен қаржы құралдарымен келесі мәмілелер жасалуға жатады.

№ р/с	Мәміле түрі <sup>1</sup>	Қаржы құралының атауы <sup>2</sup>	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	Валюта <sup>3</sup>	Мәміленің көлемі (көлем диапазоны) <sup>4</sup>	Мәміле бағасы (баға диапазоны) <sup>5</sup>	Мәміле сомасы (сома диапазоны)	Мәмілені жасау мерзімі	Нарық <sup>6</sup> , брокер <sup>7</sup>	Қосымша шарттар мен шектеулер <sup>8</sup>
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1.										
2.										
3.										

- 1 Мәміленің түрінен басқа (мысалы, сатып алу) Қазақстан Республикасының "Акционерлік қоғамдар туралы" заңының 68 бабына сәйкес осы мәміленің ірі болып табылатыны көрсетілуі тиіс.
- 2 Биржаның активтерін инвестициялау (инвестицияланған) ұсынылатын мерзімді салымға Қазақстан Республикасының қаржы құралы эмитентінің немесе екінші деңгейдегі банктің атауын қоса алғанда.
- 3 ISO 4217 Халықаралық стандартына сәйкес қаржы құралының номиналдық құнын деноминациялау валютасының алфавиттік коды.
- 4 Қаржы құралының өлшем бірлігімен.
- 5 Қаржы құралының оның өлшем бірлігі үшін ақшамен немесе ол бойынша кірістіліктің (сыйақының) жылдық мөлшерлемесінің пайызымен көрсетілген бағасы.
- 6 П – бастапқы. В – қайталама. О – ұйымдастырылған. Н – ұйымдастырылмаған. К – қазақстандық. И – шетелдік (халықаралық).
- 7 Брокердің қысқартылған атауы немесе атауының аббревиатурасы немесе брокердің оны бірегей сәйкестендіруге мүмкіндік беретін өзге де қысқаша белгісі (мысалы, сауда-саттықты ұйымдастырушы берген сауда-саттық коды).
- 8 Мысалы, мәміленің рұқсат етілген мерзімі немесе Биржаның активтерін инвестициялау мерзімі.

**Ескертпе:**

Егер қаржы құралы – мәміле заты Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіндегі мерзімді салым болып табылған жағдайда, инвестициялық шешім кестесінің 4, 6 және 7 бағандары толтырылмайды.

**Биржаның Инвестициялық комитетінің мүшелері:**

Лауазымы	[қолы]	Инициалдары, тегі
Лауазымы	[қолы]	Инициалдары, тегі
Лауазымы	[қолы]	Инициалдары, тегі
Лауазымы	[қолы]	Инициалдары, тегі

## "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
XXXX жылдың айында

- Биржаның меншікті портфелі бойынша
- клирингілік қорлардың портфелі бойынша
- клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі бойынша

қаржы құралдармен жасалған мәмілелер туралы

### Е С Е П

№ p/c	Мәмілені жасау/орындау күні	Мәміле түрі	Нарық, брокер	Қаржы құралының атауы	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	Валюта	Номиналды құны	Мәміле көлемі	Мәміле бағасы	Мәміле сомасы	Қаржы құралының кірістілігі	Қаржы құралының айналыс мерзімінің басталу күні	Қаржы құралының айналым мерзімінің аяқталу күні (өтеу күні)	Инвестициялық шешімнің нөмірі	Толық сәйкестік (сәйкессіздік)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16
1.															
2.															

**Толтыру бойынша түсіндірмелер**

1. Жалпы түсініктеме. Егер Биржа активтері инвестицияланған қаржы құралы Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіндегі мерзімді салым болып табылса, есеп кестесінің 4, 6, 8, 9 және 10 бағандары толтырылмайды.
2. Жалпы түсініктеме. Есеп кестесінің 15 және 16 бағандары қаржы құралын өтеу кезінде, оның ішінде Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіндегі мерзімді салымды қайтару кезінде толтырылмайды.
3. Есеп кестесінің 2, 13, 14 бағандарына түсіндірме. Күндер DD.MM.YY форматында көрсетіледі.
5. Есеп кестесінің 2 бағанына түсініктеме. Мәміленің жасалған және орындалған күні сәйкес келген жағдайда бір күн көрсетіледі.
6. Есеп кестесінің 3 бағанына түсініктеме. Мәміле түрінің қысқаша белгіленуі көрсетіледі, мысалы, "Сатып алу".
7. Есеп кестесінің 4 бағанына түсініктемелер:
  - 1) пайдаланылатын нарықтардың белгілері: П – бастапқы, В – қайталама, О – ұйымдастырылған, Н – ұйымдастырылмаған, К – қазақстандық, И – шетелдік (халықаралық);
  - 2) брокерді белгілеу үшін брокердің қысқартылған атауы немесе атауының аббревиатурасы немесе брокердің оны бірегей сәйкестендіруге мүмкіндік беретін өзге де қысқаша белгісі (мысалы, сауда-саттықты ұйымдастырушы берген сауда-саттық коды) пайдаланылады.
8. Есеп кестесінің 5 бағанына түсініктеме. Биржаның активтері инвестицияланған мерзімді салымға Қазақстан Республикасының қаржы құралы эмитентінің немесе екінші деңгейдегі банкінің атауы қосымша көрсетілуі тиіс.
9. Есеп кестесінің 7 бағанына түсініктеме. ISO 4217 Халықаралық стандартына сәйкес қаржы құралының номиналдық құнын деноминациялау валютасының алфавиттік коды көрсетіледі.
10. Есеп кестесінің 9 бағанына түсініктеме. Мәміле көлемі қаржы құралының өлшем бірлігінде көрсетіледі.
11. Есеп кестесінің 10 бағанына түсініктеме. Мәміле бағасы қаржы құралының өлшем бірлігі үшін ақшамен көрсетіледі.
12. Есеп кестесінің 12 бағанына түсініктеме. Қаржы құралының кірістілігі мәмілеге сәйкес көрсетіледі.
13. Есеп кестесінің 16 бағанына түсініктеме. Инвестициялық шешімнің шарттарына сәйкес толық сәйкестік (сәйкессіздік) көрсетіледі.

## Активтерді инвестициялау ережелері

---

---

Айдың басындағы меншікті портфелі/клирингілік қорлар портфелі/кепілдік берілген қатысушылар портфелі бойынша инвестициялық портфельдің мөлшері, теңге: \_\_\_\_\_.

Айдың соңындағы меншікті портфелі/клирингілік қорлар портфелі/ кепілдік берілген қатысушылар портфелі бойынша инвестициялық портфельдің мөлшері, теңге: \_\_\_\_\_.

Ауытқуы ( $\pm$ ), теңге: \_\_\_\_\_.

Ауытқудың себебі: \_\_\_\_\_

---

Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы

[қолы]

Инициалдары, тегі

Келісілді:

Тәуекелдерді басқару бөлімінің басшысы

[қолы]

Инициалдары, тегі

## "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
XXXX жылдың айындағы

- Биржаның меншікті портфелі бойынша  
 клирингілік қорлардың портфелі бойынша  
 клирингілік қатысушыларды қамтамасыз ету портфелі бойынша

### ҚҰРАМЫ МЕН ҚҰРЫЛЫМЫ ТУРАЛЫ МӘЛІМЕТТЕР

№ р/с	Қаржы құралының атауы <sup>1</sup>	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	Валюта <sup>2</sup>	Номиналды құны	Саны <sup>3</sup>	Сатып алу бағасы <sup>4</sup>	Сатып алу күні <sup>5</sup>	Өтеу күні <sup>5</sup>	Қаржы құралының табыстылығы <sup>6</sup>	Қаржы құралының ағымдағы құны	
										бірлігіне	барлығы
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1.											
2.											
3.											

- <sup>1</sup> Биржаның активтері инвестицияланған мерзімді салымға Қазақстан Республикасының қаржы құралы эмитентінің немесе екінші деңгейдегі банкінің атауын қоса алғанда.
- <sup>2</sup> ISO 4217 Халықаралық стандартына сәйкес қаржы құралының номиналдық құнын деноминациялау валютасының алфавиттік коды.
- <sup>3</sup> Қаржы құралының өлшем бірлігімен.
- <sup>4</sup> Қаржы құралының өлшем бірлігі үшін.
- <sup>5</sup> DD.MM.YY форматында.
- <sup>6</sup> Қаржы құралының номиналды кірістілігі.

**Ескертпе:**

Егер Биржа активтері инвестицияланған қаржы құралы Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банкіндегі мерзімді салым болып табылса, мәліметтер кестесінің 3, 5, 7 және 11 бағандары толтырылмайды.

Қаржы-әкімшілік департаментінің басшысы

[қолы]

Инициалдары, тегі