

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор Биржасы" АҚ
Директорлар кеңесінің шешімімен

(2020 жылдың 15 мамырындағы
№ 64 отырыс хаттамасы)
б е к і т і л д і

2020 жылдың 18 мамырынан бастап
қолданысқа енгізілді

Дефолттарды реттеу жөніндегі Комитет туралы **ҚАҒИДА**

*(Бұл тақырып Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсанындағы шешімімен
өзгертілген)*

Алматы қ.

2020

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. № 1 өзгертулер:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2020 жылдың 25 желтоқсанындағы № 167 отырыс хаттамасы);
- 2020 жылдың 28 желтоқсаннан бастап қолданысқа енгізілді.

2. № 2 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2021 жылдың 19 наурызындағы № 28 отырыс хаттамасы);
- 2021 жылдың 25 наурызынан бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Қағида "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) Дефолттарды реттеу комитетінің (бұдан әрі – Комитет) құрылу, жұмыс істеу тәртібін және функцияларын, Комитет мүшелерінің құрамын, құқықтарын, жауапкершілігін және Комитет қызметінің регламентін анықтайды (*Кіріспе Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы шешімімен өзгертілді*).

1 бап. Жалпы қағидалар

1. Комитет Биржа Басқармасы Төрағасының бұйрығымен құрылатын Биржа Басқармасы жанындағы тұрақты жұмыс істейтін орган болып табылады, оның міндеті Биржа орталық контрагент қызметін атқаратын нарықтарда дефолттарды реттеуге бағытталған мәмілелерді, Биржаның корреспонденттік шоттарында тапшылық туындаған жағдайда өтімділікті тартуға бағытталған мәмілелерді жасау шарттарын айқындау болып табылады. (*бұл тармақ Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы және 2021 жылдың 19 наурыздағы шешімдерімен өзгертілді*).
2. Комитет өз қызметінде Қазақстан Республикасының заңнамасын, осы Ережені, Биржаның ішкі нормативтік құжаттарын басшылыққа алады.
3. Комитет Биржа басқармасына есеп береді және осы Ережеге сәйкес Биржа Басқармасы берген өкілеттіктер шеңберінде әрекет етеді.
4. Комитеттегі мүшелікке қосымша ақы белгіленбейді.

2 бап. Комитет Құрамы

1. Комитет құрамына мыналар кіреді:
 - 1) тәуекелдерді басқару бөлімшесіне жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі;
 - 2) эмитенттермен және инвесторлармен жұмыс бойынша бөлімшеге жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі;
 - 3) клирингтік бөлімшесіне жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі;
 - 4) клирингтік бөлімшесінің басшысы;
 - 5) сауда-саттық бөлімшесінің басшысы;
 - 6) қаржы-әкімшілік бөлімшесінің қазынашылық басшысы.

(*Бұл тармақ Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы және 2021 жылдың 19 наурыздағы шешімдерімен өзгертілді*)

- 1.1. Комитет төрағасы болып тәуекелдерді басқару бөлімшесіне жетекшілік ететін Биржа Басқармасының мүшесі тағайындалады (*бұл тармақ Биржа Басқармасының 2021 жылдың 19 наурыздағы шешімімен енгізілген*).
2. Комитет Төрағасы Комитет қызметіне басшылықты жүзеге асырады және мынадай функцияларды жүзеге асырады:
 - 1) Комитеттің жұмысын ұйымдастырады;
 - 2) Комитеттің отырыстарын шақырады және оларға төрағалық етеді;
 - 3) Комитет отырысының күн тәртібін бекітеді;
 - 4) Комитет отырысын өткізу нысанын айқындайды;
 - 5) Комитет отырыстарында мәселелерді талқылауды ұйымдастырады, сондай-ақ отырысқа қатысуға шақырылған адамдардың пікірлерін тыңдайды;

- 6) Комитет мүшелері арасында міндеттерді бөледі, оларға және Комитет хатшысына Комитет отырысында қарау үшін мәселелерді зерделеуге және дайындауға байланысты тапсырмалар береді;
- 7) Комитет шешімдерінің орындалуын бақылайды.
3. Комитет жұмысын ұйымдастырушылық және ақпараттық қамтамасыз ету жөніндегі функцияларды Комитет хатшысы жүзеге асырады. Комитет хатшысы Биржа Басқармасы Төрағасының бұйрығымен Қаржы-әкімшілік департаменті қызметкерлерінің қатарынан тағайындалады.
4. Комитет хатшысы:
 - 1) Комитет отырыстарын дайындау және өткізу;
 - 2) отырыстарға материалдарды жинау және жүйелеу;
 - 3) комитет отырысының күн тәртібін немесе Комитет мүшелерінің сырттай дауыс беруін қалыптастыру;
 - 4) комитет мүшелеріне және шақырылған адамдарға Комитет отырыстарын өткізу туралы хабарламаларды, отырыстардың күн тәртібін, күн тәртібіндегі мәселелер бойынша материалдарды уақтылы жіберу;
 - 5) отырыстарды хаттамалау, сондай-ақ Комитет отырыстарының хаттамаларын (шешімдерін) кейіннен сақтау;
 - 6) қажеттілігіне қарай Комитеттің хаттамаларынан (шешімдерінен) үзінді көшірмелер беру;
 - 7) Комитет төрағасының немесе өзге мүшелерінің тапсырмасы бойынша өзге де функцияларды орындау.
5. Биржа Басқармасы Төрағасының бұйрығымен Комитеттің дербес құрамы, сондай-ақ осы баптың 1 тармағының 2) және 3) тармақшаларында көрсетілген Комитет мүшелерін алмастыруды қоспағанда, оларды алмастыратын адамдар тағайындалады *(бұл тармақ Биржа Басқармасының 2021 жылдың 19 наурыздағы шешімімен енгізілген)*.

3 бап. Комитеттің функциялары

Комитеттің негізгі функциялары::

- 1) дефолттарды реттеуге бағытталған мәмілелер жасасу шарттары туралы шешімдерді айқындау және қабылдау;
- 2) Биржаның корреспонденттік шоттарында тапшылық туындаған жағдайда өтімділікті тартуға бағытталған мәмілелер жасасу шарттары туралы шешімдерді айқындау және қабылдау.

(Осы бап Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы шешімімен өзгертілді)

4 бап. Комитеттің жұмыс тәртібі

1. Комитеттің отырыстары Комитет төрағасының шешімімен күндізгі немесе сырттай нысанда өткізіледі.
2. Отырыс сырттай нысанда өткізілген жағдайда Комитеттің әрбір мүшесі дауыс беру нәтижелері мен ерекше пікірі (бар болса) көрсетілген бюллетеньге қол қояды. Хатшы дауыс беру бюллетеньдерінің негізінде хаттама дайындайды.
3. Комитет отырысы комитет Төрағасының бастамасы бойынша немесе Комитет Төрағасының бастамасы бойынша шақырылуы мүмкін:
 - 1) Комитеттің кез келген мүшесінің;

- 2) Басқарма мүшесі;
- 3) орталық контрагенттің өтімділігін басқаруға жауапты бөлімшенің (бұдан әрі –жауапты бөлімше) қызметкері.

Комитеттің отырысы Комитетті шақыруға бастамашы болған адамды міндетті түрде шақыра отырып өткізіледі.

4. Комитет қызметін жүзеге асырған кезде Комитет мүшелері мен Комитет мүшелері болмаған және/немесе мүдделер қақтығысы туындаған жағдайда оларды ауыстыруға уәкілетті адамдар арасында қашықтықтан қарым-қатынастың негізгі құралы электрондық пошта немесе өзге де байланыс құралдары, оның ішінде хабарламалармен электрондық алмасу құралдары болып табылады.
5. Комитет отырысының күн тәртібін ұсынылған материалдар негізінде Комитет хатшысы қалыптастырады және оны Комитет Төрағасы бекітеді.
6. Комитет отырысын өткізу/шақыру туралы хабарламаны бекітілген күн тәртібі мен күн тәртібінің мәселелері бойынша қажетті материалдарды қоса бере отырып, өткізу уақыты мен орнын көрсете отырып, Комитет хатшысы Комитет мүшелеріне электрондық пошта арқылы немесе Комитет отырысының уақытына дейін өзге де байланыс құралдары арқылы жібереді.
7. Комитет мүшесінің(мүшелерінің) ұсынысы бойынша Комитет отырысқа қатысушы комитет мүшелерінің көпшілігінің келісімі болған жағдайда және осы мәселелер бойынша барлық қажетті материалдар болған кезде күн тәртібіне енгізілмеген мәселелерді отырыста қосымша қарауға құқылы.
8. Комитеттің отырысы, егер оған Комитет мүшелерінің кемінде жартысы қатысса, заңды болып табылады (кворумы болады).
9. Комитеттің шешімі отырысқа қатысып отырған Комитет мүшелерінің көпшілік дауысымен қабылданады. Комитеттің әрбір мүшесі бір дауысқа ие. дауыстар тең болған жағдайда Комитет Төрағасының дауысы шешуші болып табылады.
10. Комитет мүшесінің дауыс беру құқығын Комитеттің басқа мүшесіне немесе қызметкеріне беруге тыйым салынады.
11. Комитет отырысын бекітілген күн тәртібіне сәйкес Комитет Төрағасы ашады.
12. Комитет отырысына қатысу үшін Комитет мүшелерінен басқа, дауыс беруге қатысу құқығы жоқ өзге де адамдар тартылуы мүмкін.

5 бап. Комитет мүшелеріне материалдар дайындау және ұсыну

1. Күн тәртібінің әрбір мәселесі бойынша материалдар мыналарды қамтуға тиіс:
 - 1) мәмілелер жасасудың шарттары туралы жауапты бөлімшенің ұсыныстары;
 - 2) қаралатын сауда-клирингілік шоттардағы қаржы құралдары бойынша ағымдағы міндеттемелер мен талаптар туралы қажетті ақпарат;
 - 3) қор нарығындағы дефолттарды реттеу тәртібінің 4 тарауында көрсетілген мәліметтерді қамтитын басқа да қажетті материалдар.
2. Орталық контрагенттің (ОК) міндеттемелерін орындау үшін өтімділікті тартуға бағытталған мәмілелер жасасу туралы мәселені Комитеттің қарауына шығарған кезде жауапты бөлімше материалдарға мынадай құжаттарды қоса береді:

- 1) Биржаның корреспонденттік шоттарындағы қалдықтар туралы мәліметтер *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы шешімімен өзгертілді)*;
 - 2) Биржаның корреспонденттік шоттарынан клирингілік қатысушылардың пайдасына алдағы ақша аударымдары туралы мәліметтер *(осы тармақша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 25 желтоқсандағы шешімімен өзгертілді)*;
 - 3) клиринг бөлімшесінің жосықсыз клирингілік қатысушы позициясын ауыстыруы салдарынан ОК-нің жеке сауда-клирингілік шотына түскен бағалы қағаздар туралы мәліметтер.
3. Дәрменсіз клирингілік қатысушының дефолтын реттеуге бағытталған мәмілелер жасасу туралы мәселені Комитеттің қарауына шығарған кезде жауапты бөлімше материалдарға мынадай құжаттарды қоса береді:
- 1) дәрменсіз клирингілік қатысушының ақшасы бойынша міндеттемелер мен талаптар туралы мәліметтер;
 - 2) дәрменсіз клирингілік қатысушының бағалы қағаздары бойынша міндеттемелері мен талаптары туралы мәліметтер;
 - 3) клирингілік қатысушының ақшасы бойынша позициялар туралы мәліметтер;
 - 4) клирингілік қатысушының KASE бөліміндегі бағалы қағаздар туралы мәліметтер;
 - 5) дефолтты реттеуге бағытталған мәмілелер параметрлері туралы ұсынымдар.
4. Материалдар Комитет хатшысына комитет отырысы басталғаннан кешіктірілмей ұсынылады.

6 бап.

Комитет отырысының хаттамасы

1. Комитеттің мәмілелер жасасу шарттары жөніндегі шешімі осы Қағидаға 1-қосымшаға сәйкес ресімделеді, мәмілелер жасасу жөніндегі нұсқауларды қамтиды және оған Комитеттің отырысқа қатысқан барлық мүшелері қол қояды.
2. Шешімнен басқа, Комитет отырысының хаттамасы да ресімделеді, оны Комитет хатшысы отырыс өткізілген күннен бастап екі жұмыс күні ішінде жасауға және Комитеттің отырысқа қатысқан мүшелеріне келісуге ұсынуға тиіс.

Осы тармақтың бірінші абзацына сәйкес отырыс хаттамасын Комитет мүшелеріне келісуге жіберу корпоративтік электрондық поштаны пайдалана отырып жүзеге асырылады.

Отырысқа қатысқан Комитет мүшелерінің хаттама жобасына ескертулері және/немесе ұсыныстары болған кезде Комитет хатшысы хаттаманы пысықтауға тиіс.
3. Комитет отырысының хаттамасында мынадай мәліметтер қамтылуға тиіс:
 - 1) Комитеттің толық атауы және комитет отырысының орны;
 - 2) отырысты өткізу күні, уақыты және орны;
 - 3) отырысқа қатысқан адамдар туралы мәліметтер;
 - 4) отырысының күн тәртібіне;
 - 5) дауыс беруге қойылған мәселелер және олар бойынша дауыс беру қорытындылары;

- 6) осы Қағидаға 1 қосымшаға сәйкес ресімделген қабылданған шешімдер;
 - 7) Комитеттің шешімі бойынша өзге де мәліметтер.
4. Хаттамаға Комитет Төрағасы қол қояды. Хатшы Комитет мүшелерін хаттамамен таныстыруды қамтамасыз етеді. Комитет отырыстары хаттамаларының түпнұсқалары, шешімдердің түпнұсқалары, сондай-ақ Комитеттің күн тәртібіндегі мәселелер бойынша материалдар Комитет хатшысында сақталады.
 5. Комитет хатшысы Комитет шешімдерінің (тапсырмаларының) орындалуын бақылауды және мониторингін жүзеге асырады және олардың орындалу мәртебесі туралы ақпаратты комитет мүшелеріне береді.

7 бап.

Комитет мүшелерінің құқықтары, міндеттері және жауапкершілігі

1. Осы Қағиданың 3 бабында көрсетілген функцияларды жүзеге асыру кезінде Комитет құқылы:
 - 1) осы Қағидамен және/немесе Биржа Басқармасының тапсырмасы бойынша оның құзыретіне жатқызылған кез келген мәселелерді алдын ала зерделеу және қарау;
 - 2) Биржаның құрылымдық бөлімшелерінен қажетті ақпаратты сұрату;
 - 3) Комитеттің отырыстарына қатысу үшін Биржаның құрылымдық бөлімшелерінің қызметкерлерін және/немесе сыртқы сарапшыларды тарту;
 - 4) ОК өтімділігін басқаруға жауапты бөлімше орындауға жататын, қор нарығындағы дефолттарды реттеуге бағытталған мәмілелер жасасу шарттарына қатысты шешімдерді қабылдау;
 - 5) жауапты бөлімше орындауға жататын Орталық депозитарийдегі Биржаның корреспонденттік шотында тапшылық туындаған жағдайда өтімділікті тартуға бағытталған мәмілелер жасасу шарттарына қатысты шешімдер қабылдау;
 - 6) Басқарманың ұсыныстарын қабылдау.
2. Комитет мүшелері және Комитет мүшелерін алмастыруға уәкілетті (құқығы бар) тұлғалар:
 - 1) тәуелсіз және объективті болу;
 - 2) Комитет мүшелерінің өкілеттіктерін жүзеге асыруға байланысты өздері алған ақпараттың, оның ішінде коммерциялық, қызметтік немесе заңмен қорғалатын өзге де құпияны құрайтын ақпараттың құпиялылығын қамтамасыз етуге міндетті және осындай міндетті бұзғаны үшін Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес жауапты болады.
3. Комитет Төрағасы, мүшелері және Комитет мүшелерін алмастыруға уәкілетті (құқығы бар) тұлғалар Қазақстан Республикасының заңнамасына, осы Ережеге және Биржаның басқа да ішкі құжаттарына сәйкес қойылған мақсаттар мен функциялардың орындалуына жауапты болады.
4. Комитет мүшесі құқылы:
 - 1) Комитеттің өзінің негізгі міндеттеріне сәйкес келетін мәселелерді қарауына бастамашылық ету;
 - 2) Комитет қарайтын мәселе бойынша толыққанды, негізделген пікірді қалыптастыру үшін қажетті және жеткілікті көлемде ақпарат алу;

- 3) Комитеттің отырыстарына қатысу үшін Биржаның құрылымдық бөлімшелерінің қызметкерлерін және/немесе сыртқы сарапшыларды тарту;
- 4) Комитет мүшесі ретінде алдына қойылған міндеттер мен функцияларды орындау үшін қажетті өзге де шараларды қабылдайды.
5. Комитет отырысының күн тәртібіне енгізілген мәселелер бойынша материалдарды комитет мүшелеріне уақтылы ұсыну үшін Комитеттің хатшысы жауапты болады.

Комитет хатшысы сондай-ақ Комитет жұмысы шеңберінде алынған құпия ақпаратты жария еткені үшін жауапты болады.

8 бап.

Тұжырымды қағидалар

1. Осы Қағидаға өзгерістердің және/немесе толықтырулардың (өзектілендірудің) уақтылы енгізілуіне жауапкершілік Қаржы-әкімшілік департаментіне жүктеледі.
2. Осы Қағида қажеттілігіне қарай, бірақ осы Қағида қолданысқа енгізілген күннен бастап есептелетін бес жылда кемінде бір рет өзектілендіруге жатады.

Басқарма Төрайымы

А.Ө. Алдамберген

Қор нарығындағы
дефолттарды реттеу
жөніндегі Комитет туралы
Қағидаға

1 қосымша

Дефолтты реттеу бойынша

Ш Е Ш І М

[Күні]

ОК үшін өтімділікті тарту

Тарту сомасы:

Клирингілік қатысушының дефолтын реттеу

Дефолт орын алған сауда-саттық шоты:

[сауда-саттық коды]

Фирма коды:

[фирма коды]

Дефолт түрі:

[дефолт түрі]

Клирингілік қатысушыны дәрменсіз деп тану күні:

[хаттаманың күні мен нөмірі]

Үздіксіз қарсы аукцион әдісімен мәміле жасасуға арналған өтінімдердің сипаттамасы

1) Тәртіптеме коды: [ТКС ASTS + тәртіптеме кодын көрсету]

Өтінім түрі: [Лимиттік/Нарықтық]

Құрал коды: [қаржы құралының коды]

ISIN: [ISIN қағаз (бар болса)]

Жолдау: [Мәміленің бағытын көрсету]

Лоттар саны: XXXX

Баға диапазоны: XXXX кем емес, бірақ XXXX артық емес

Қосымша түсініктемелер және шарттар (бар болса):

2) Тәртіптеме коды: [ТКС ASTS + тәртіптеме кодын көрсету]

Өтінім түрі: [Лимиттік/Нарықтық]

Құрал коды: [қаржы құралының коды]

ISIN: [ISIN қағаз (бар болса)]

Жолдау: [Мәміленің бағытын көрсету]

Лоттар саны: XXXX

Баға диапазоны: XXXX кем емес, бірақ XXXX артық емес

Қосымша түсініктемелер және шарттар (бар болса):

...

Тікелей мәмілелер әдісімен мәміле жасасуға арналған өтінімдердің сипаттамасы

- 1) Тәртіптеме коды: [ТКС ASTS + тәртіптеме кодын көрсету]
Өтінім түрі: [Лимиттік/Нарықтық]
Құрал коды: [қаржы құралының коды]
ISIN: [ISIN қағаз (бар болса)]
Жолдау: [Мәміленің бағытын көрсету]
Контрагент қатысушысының коды: [фирма коды]

Лоттар саны: XXXX

Бағасы: XXXX кем емес, бірақ XXXX артық емес

Басқа ұсынылған баға белгілеулер

- 1) Тәртіптеме коды: [ТКС ASTS тәртіптеме кодын көрсету +]
Өтінім түрі: [Лимиттік/Нарықтық]
Құрал коды: [қаржы құралының коды]
ISIN: [ISIN қағаз (бар болса)]
Жолдау: [Мәміленің бағытын көрсету]
Қатысушы коды: [фирма коды]

Лоттар саны: XXXX

Бағасы: XXXX кем емес, бірақ XXXX артық емес

Комитет мүшелерінің ерекше пікірі

* * *

Комитет жауапты бөлімшеге клирингтік қатысушының дефолтын белгіленген реттілік шеңберінде реттеуді тапсырады.

Шешімнің қолданылу мерзімі:

Күні:

уақыт кезеңі:

Комитет Мүшелері:

Комитет мүшесі 1

[Қолы]

Комитет мүшесі 2

[Қолы]

Комитет мүшесі 3

[Қолы]

Комитет мүшесі 4

[Қолы]

Комитет мүшесі 5

[Қолы]

Комитет шешімін орындаушы

Жауапты бөлімшенің қызметкері

[Қолы]