

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

**У т в е р ж д е н а**

решением Правления  
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания  
от 01 ноября 2019 года № 135)

**Введена в действие**

с 03 декабря 2019 года

## МЕТОДИКА

расчета индикативных показателей рынка  
репо с ЦК

---

г. Алматы

2019

## **ЛИСТ ПОПРАВК**

### **1. Изменения № 1:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 12 августа 2021 года № 86);
- введены в действие с 18 августа 2021 года.

### **2. Изменения и дополнения № 2:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 04 августа 2022 года № 95);
- введены в действие с 22 августа 2022 года.

Настоящая Методика определяет перечень индикативных показателей рынка репо с финансовыми инструментами, по которым АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) осуществляет клиринговую деятельность на фондовом рынке с использованием услуг Центрального контрагента (далее – репо с ЦК), и порядок расчета этих показателей.

## Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящей Методике используются понятия, определенные другими внутренними документами Биржи.
2. Для целей Методики используются:
  - 1) под сделками рынка репо с ЦК понимаются сделки операций автоматического репо с финансовыми инструментами, заключенные на проводимых Биржей торгах с использованием услуг Центрального контрагента;
  - 2) под финансовыми инструментами понимаются ценные бумаги, включая производные ценные бумаги, входящие в Список Т+, порядок включения в который определен документом Биржи "Порядок включения финансовых инструментов в Список Т+ и в Список обеспечения Т+";
  - 3) под результативным днем для какого-либо финансового инструмента понимается день, в течение которого с данным финансовым инструментом в торговой системе Биржи заключена хотя бы одна сделка;
  - 4) под КСУ понимается неэмиссионная ценная бумага, выпускаемая Биржей, как клиринговой организацией, выполняющей функции центрального контрагента, удостоверяющая право ее владельца на долю активов, находящихся в имущественном гарантийном фонде Биржи (*данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года*);
  - 5) под Корзиной ГЦБ понимается список ценных бумаг, определенный в соответствии с внутренними документами Биржи (*данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года*).
3. Биржа рассчитывает следующие индикативные показатели по сделкам с финансовыми инструментами рынка репо с ЦК (далее – индикаторы):
  - 1) REPOUS1D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК сроком на один день с расчетами в долларах США;
  - 4) REPOUS1W – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК сроком на семь дней с расчетами в долларах США;
  - 5) REPOUS14D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК сроком на четырнадцать дней с расчетами в долларах США;
  - 7) REPOUS30D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК сроком на тридцать дней с расчетами в долларах США;
  - 8) REPObn1D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долговым ценным бумагам сроком на один день с расчетами в тенге;
  - 11) REPObn1W – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долговым ценным бумагам сроком на семь дней с расчетами в тенге;
  - 12) REPObn14D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долговым ценным бумагам сроком на четырнадцать дней с расчетами в тенге;
  - 13) REPObn30D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долговым ценным бумагам сроком на тридцать дней с расчетами в тенге;
  - 14) REPOsh1D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долевым ценным бумагам сроком на один день с расчетами в тенге;

- 17) REPOsh1W – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долевым ценным бумагам сроком на семь дней с расчетами в тенге;
  - 18) REPOsh14D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долевым ценным бумагам сроком на четырнадцать дней с расчетами в тенге;
  - 19) REPOsh30D – средневзвешенная процентная ставка по операциям автоматического репо с ЦК по долевым ценным бумагам сроком на тридцать дней с расчетами в тенге;
  - 20) REPGCC\_1D– средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на один день с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 21) REPGCC\_1W – средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на семь дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 22) REPGCC\_2W– средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на четырнадцать дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 23) REPGCC\_1M– средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на тридцать дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 24) REPGCC\_2M– средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на шестьдесят дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 25) REPGCC\_3M– средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с КСУ со сроком на девяносто дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*.
  - 26) REPOgb14D–средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с Корзиной ГЦБ со сроком на четырнадцать дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 27) REPOgb30D–средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с Корзиной ГЦБ со сроком на тридцать дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*;
  - 28) REPOgb90D–средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с Корзиной ГЦБ со сроком на девяносто дней с расчетами в тенге *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*.
4. Используемые в настоящей Методике термины могут также применяться в других внутренних документах Биржи, в служебной документации, переписке Биржи и в биржевой информации.
  5. Изменения и/или дополнения в настоящую Методику подлежат размещению (опубликованию) на официальном интернет-сайте Биржи не менее чем за 10 дней до даты ввода этих изменений и/или дополнений, за исключением изменений и/или дополнений, которые носят редакционный и/или уточняющий характер и не влияют на порядок.

## Глава 2. ОБЩИЕ УСЛОВИЯ РАСЧЕТА ИНДИКАТОРОВ

6. Значения индикаторов рассчитываются Биржей с точностью до двух знаков после запятой с округлением по правилам математического округления (цифры до пяти уменьшаются до нуля, а цифры от пяти и выше увеличиваются до десяти) *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года)*.
7. При отсутствии в течение торгового дня сделок, параметры которых необходимы для осуществления расчета какого-либо индикатора, расчет данного индикатора в этот день не производится.

- В целях обеспечения адекватности значений индикаторов объективным характеристикам финансового рынка данные значения могут быть скорректированы Комитетом по индексам и индикаторам. Условия и порядок такой корректировки определены главой 4 настоящей Методики (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года*).

### Глава 3. РАСЧЕТ ИНДИКАТОРОВ РЫНКА ОПЕРАЦИЙ РЕПО

- Расчет индикаторов рынка операций репо осуществляется в течение каждого торгового дня Биржи по мере заключения сделок. Расчет каждого нового значения индикаторов происходит после заключения каждой сделки открытия операции репо по соответствующему инструменту.
- Индикаторы, указанные в пункте 3 настоящей Методики рассчитываются на основе параметров всех сделок открытия операций репо с ЦК в день расчета индикатора к моменту его расчета, по следующей формуле:

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

- Y – средневзвешенная ставка репо в % годовых;
- V<sub>i</sub> – объем i-й сделки открытия операции репо в тенге;
- Y<sub>i</sub> – ставка репо по i-й сделке открытия операции репо в % годовых;
- n – количество сделок открытия операций репо.

- Расчет индикаторов производится с учетом особенностей заключения сделок открытия и закрытия репо, установленных внутренним документом биржи "Правила осуществления операций репо в торгово-клиринговой системе ASTS+" (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 04 августа 2022 года*).
- Расчет индикаторов осуществляется с точностью до двух знаков после запятой и выражаются в процентах.

### Глава 4. ОСОБЫЕ ПОЛНОМОЧИЯ КОМИТЕТА ПО ИНДЕКСАМ И ИНДИКАТОРАМ В ОТНОШЕНИИ ИНДИКАТОРОВ

*(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года)*

- Комитет по индексам и индикаторам (далее – Комитет) вправе корректировать значения индикаторов, исключая из их расчетов параметры тех сделок, которые, по мнению Комитета, нерепрезентативно влияют (повлияли) на эти значения (например, неисполненных сделок, сделок, при заключении которых были допущены технические ошибки, сделок, цены которых явно диссонируют с рыночным состоянием и/или рыночной динамикой цен соответствующих инструментов) (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года*).
- В случае принятия Комитетом решения об исключении из расчета того или иного индикатора параметров какой-либо сделки (каких-либо сделок) соответствующий перерасчет данного индикатора осуществляется не позднее рабочего дня, следующего за днем, в который было получено нерепрезентативное значение данного индикатора.
- При использовании Комитетом своих особых полномочий в соответствии с пунктом 13 настоящей Методики в протоколе его заседания должны быть отражены причины использования этих полномочий и действия, предпринятые им в соответствии с этими полномочиями.

**Глава 5. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

16. Ответственность за своевременное внесение в настоящую Методику изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на Департамент информации и статистики.
17. Настоящая Методика подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.