

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 14 сентября 2018 года № 99)

Введен в действие

с 17 сентября 2018 года

ПОРЯДОК

включения финансовых инструментов
в Список финансовых инструментов
фондового рынка, по сделкам с которыми
Биржа осуществляет клиринговую
деятельность

г. Алматы

2018

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения и дополнения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 декабря 2018 года № 142);
- введены в действие с 11 декабря 2018 года.

2. Дополнения № 2:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 19 декабря 2018 года № 148);
- введены в действие с 20 декабря 2018 года.

3. Дополнения и изменения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 05 апреля 2019 года № 45);
- будут введены в действие с 08 апреля 2019 года.

Настоящий Порядок разработан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и внутренними документами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) и содержит описание порядка формирования Списка финансовых инструментов фондового рынка, по сделкам с которыми Биржа осуществляет клиринговую деятельность (далее – Список), а также условия включения финансовых инструментов в Список и исключения из него.

Статья 1. Общие положения

1. В настоящем Порядке используются понятия и термины, определенные законодательством Республики Казахстан, Правилами клиринга и другими внутренними документами Биржи.
2. Список состоит из:
 - финансовых инструментов фондового рынка, расчеты по сделкам с которыми осуществляются в национальной валюте (далее – финансовые инструменты с расчетами в тенге), соответствующих требованиям пункта 1 статьи 2 настоящего Порядка,
 - финансовых инструментов фондового рынка, расчеты по сделкам с которыми осуществляются в долларах США (далее – финансовые инструменты с расчетами в долларах США), соответствующих требованиям пункта 2 статьи 2 настоящего Порядка.
3. Список формируется на основании решений Правления Биржи, с учетом особенности, установленной пунктом 1-1 статьи 4 настоящего Порядка *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.
4. Включение в Список/исключение из Списка финансового инструмента с расчетами в тенге является основанием для нахождения данного финансового инструмента в секции "Т+2 в тенге" и "репо с неттингом в тенге". Включение в Список /исключение из Списка финансового инструмента с расчетами в долларах является основанием для нахождения данного финансового инструмента в секции "Т+2 в долларах США" и "репо с неттингом в долларах США" *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 10 декабря 2018 года)*.

Статья 2. Требования, предъявляемые к финансовым инструментам

1. Для включения в Список финансового инструмента с расчетами в тенге такой финансовый инструмент должен в течение четырех последовательных календарных месяцев, предшествующих включению в Список, находиться в списке ценных бумаг первого класса ликвидности, сформированном в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг" *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.
2. Для включения в Список финансового инструмента с расчетами в долларах США, такой финансовый инструмент должен соответствовать следующим требованиям:
 - 1) *(данный подпункт исключен решением Правления Биржи от 10 декабря 2018 года)*;
 - 2) находиться в официальном списке Биржи;
 - 3) быть номинированным в долларах США;
 - 4) иметь рейтинговую оценку не ниже уровня "В-" по международной шкале рейтингового агентства Standard & Poor's или рейтинговую

оценку аналогичного уровня по международной шкале другого рейтингового агентства.¹

Для долговых финансовых инструментов рассматривается рейтинговая оценка, присвоенная выпуску данного финансового инструмента.

Для производных ценных бумаг, долевых финансовых инструментов и для долговых финансовых инструментов, у которых отсутствует рейтинговая оценка, присвоенная выпуску такого финансового инструмента, рассматривается рейтинговая оценка, присвоенная эмитенту данного финансового инструмента (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года*);

- 5) иметь расчетную цену, рассчитанную в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика оценки ценных бумаг";
 - 6) торговаться в "чистых" ценах (для долговых ценных бумаг) (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 10 декабря 2018 года*).
3. Определенные пунктами 1 и 2 настоящей статьи требования для включения финансового инструмента в Список, также применяются для целей определения его соответствия нахождению в Списке.

Статья 3. Мониторинг финансовых инструментов

1. В течение пяти рабочих дней после утверждения Комитетом по индексам и оценке ценных бумаг списков ценных бумаг, сформированных в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг", Биржа проводит мониторинг финансовых инструментов с расчетами в тенге и финансовых инструментов с расчетами в долларах США на соответствие критериям для их нахождения в Списке (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года*).
- 1-1. Биржа вправе осуществить внеочередное рассмотрение возможности включения финансового инструмента определенного наименования в Список на основании запроса клирингового участника, составленного в произвольной форме (*данный пункт включен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года*).
2. Финансовый инструмент может быть исключен из Списка при наступлении любого из следующих случаев:
 - 1) эмитент данного финансового инструмента, являющийся клиринговым участником (членом Биржи), не удовлетворяет минимальному уровню рейтинга согласно внутреннему документу Биржи "Методика оценки финансового состояния членов Биржи";
 - 2) объявление эмитента данного финансового инструмента о выкупе / обмене данного финансового инструмента;
 - 3) приостановление или прекращение действия лицензии эмитента финансового инструмента, являющегося клиринговым участником (членом Биржи):

¹ Для целей настоящего Порядка признаются рейтинговые оценки агентства "Standard & Poor's" или агентств "Moody's Investors Service" и "Fitch", или их дочерних рейтинговых организаций.

Если выпуск ценных бумаг или их эмитент имеет рейтинговые оценки от двух и более рейтинговых агентств, то учитывается наихудшая из таких рейтинговых оценок.

на осуществление брокерской и/или дилерской деятельности на рынке ценных бумаг для эмитента финансового инструмента, являющегося клиринговым участником на фондовом рынке (членом Биржи "фондовой" категории);

на проведение банковских операций в национальной и иностранной валютах для эмитента финансового инструмента, являющегося клиринговым участником на валютном рынке (членом Биржи "валютной" категории);

- 4) истечение (досрочное истечение) срока обращения данного финансового инструмента.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года);

- 2-1. Финансовый инструмент с расчетами в тенге может быть исключен из Списка при выходе такого финансового инструмента из списка ценных бумаг первого класса ликвидности, сформированного в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг" *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.
- 2-2. Финансовый инструмент с расчетами в долларах США может быть исключен из Списка при несоответствии финансового инструмента любому из требований пункта 2 статьи 2 настоящего Порядка *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.
3. По результатам мониторинга финансовых инструментов фондового рынка на соответствие требованиям Списка Клиринговая палата готовит соответствующее заключение об изменении Списка (далее – Заключение) и вносит его на рассмотрение Правлением Биржи *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.
4. В ходе подготовки Заключения Клиринговая палата вправе запрашивать у иных структурных подразделений Биржи дополнительную информацию и документы, необходимые по мнению Клиринговой палаты для подготовки обоснованного Заключения.
5. В Заключении указываются:
- 1) значения риск-параметров финансового инструмента, определенные в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика определения риск-параметров финансовых инструментов";
 - 2) информация, являющаяся основанием для вынесения решения о включении финансового инструмента в Список либо об исключении финансового инструмента из Списка.
6. Заключение, подготовленное в соответствии с пунктом 5 настоящей статьи, рассматривается Правлением Биржи на его ближайшем заседании.

Статья 4. Включение / исключение финансового инструмента в / из Списка

1. Правление Биржи, руководствуясь Заключением, подготовленным в соответствии с пунктом 5 статьи 3 настоящего Порядка, принимает решение о включении финансового инструмента в Список либо об исключении финансового инструмента из Списка.
- 1-1. В случаях указанных в подпунктах 3) и 4) пункта 2 статьи 3 настоящего Порядка финансовый инструмент автоматически исключается из Списка без принятия Правлением Биржи соответствующего решения *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 апреля 2019 года)*.

2. Правление Биржи вправе, не руководствуясь Заключением, и на основании своего экспертного мнения и / или дополнительных рыночных факторов принять решение:
 - о включении финансового инструмента определенного наименования в Список;
 - об исключении финансового инструмента определенного наименования из Списка.
3. Решение Правления о включении финансового инструмента в Список либо об исключении финансового инструмента из Списка доводится до сведения клиринговых участников не позднее, чем за три календарных дней до даты вступления в силу соответствующих изменений, путем публикации соответствующей новости на интернет-сайте Биржи (www.kase.kz) *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 10 декабря 2018 года)*.

Статья 5. Заключительные положения

1. Настоящий Порядок и все изменения и/или дополнения в настоящий Порядок доводятся до сведения клиринговых участников путем размещения на интернет-сайте Биржи (www.kase.kz).
2. Настоящий Порядок подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в пять лет.
3. Ответственность за своевременное внесение изменений и дополнений в настоящий Порядок несет Клиринговая палата.

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.