АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

С о г л а с о в а н о

с Национальным Банком
Республики Казахстан

29 ноября 2018 года

Заместитель Председателя
Национального Банка
Республики Казахстан

У т в е р ж д е н

решением Совета директоров
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 07 ноября 2018 года № 33)

Введен в действие

с 30 ноября 2018 года

ПОРЯДОК

заключения сделок с государственными ценными бумагами по схеме Т+2

г. Алматы

2018

Л И С Т П О П Р А В О К

1. Изменения № 1:

– утверждены решением Совета директоров АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 24 сентября 2019 года № 45);

– введены в действие с 03 декабря 2019 года.

Настоящий Порядок разработан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и определяет условия и порядок совершения сделок с государственными ценными бумагами (далее – ГЦБ) по схеме Т+2[1] (далее – порядок Т+2) в торговой системе АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), торги и расчеты по которым осуществляются в тенге.

Статья 1. Основные понятия и термины

1. В настоящем Порядке используются понятия и термины, определенные законодательством Республики Казахстан и другими внутренними документами Биржи.
2. Для целей настоящего Порядка:
   1) под ГЦБ понимаются государственные казначейские обязательства Республики Казахстан и ноты Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК);
   2) под виновным участником торгов понимается участник торгов, не исполнивший свои обязательства по заключенной им сделке;
   3) под ответственным участником торгов понимается участник торгов, заключивший сделку, со стороны которого сделка не была подтверждена пользователем системы контроля и обеспечения *(данный подпункт изменен решением Совета директоров Биржи от 24 сентября 2019 года)*;
   4) под позицией понимается сумма денег (денежная позиция) или количество ценных бумаг (позиция по ценным бумагам), учитываемые на торговых счетах участника торгов (и/или его клиентов) в торговой системе Биржи;
   5) под пострадавшим участником торгов понимается участник торгов, заключенная которым сделка не была исполнена по причине неисполнения виновным участником торгов своих обязательств по данной сделке.

Статья 2. Общие положения о порядке Т+2

1. Днем заключения сделок является торговый день Т.

   Днем сверки заключенных сделок является торговый день Т+1.

   Днем осуществления расчетов по сделкам является день Т+2.
2. Для осуществления расчетов по сделкам с ГЦБ по схеме Т+2 участник торгов должен иметь в Центральном депозитарии счета, описание которых приведено во внутреннем документе Биржи "Регламент осуществления расчетов по сделкам с ценными бумагами по схеме Т+0 с полным обеспечением (гросс-расчеты)".
3. Расчеты по сделкам осуществляются отдельно по каждой сделке по принципу поставка против платежа.
4. Расчеты по сделкам осуществляются Центральным депозитарием в соответствии с его со сводом правил.

   В случае если нормы настоящего Порядка, касающиеся осуществления расчетов или иных процедур, осуществляемых Центральным

[1] Общепринятое в мировой практике обозначение сроков осуществления расчетов по биржевым сделкам (исполнения биржевых сделок) в виде записи "Т+n", где Т – день биржевых торгов, в который заключена сделка, а n – срок в рабочих днях между днем заключения сделки и днем осуществления расчетов по этой сделке.

депозитарием, противоречат своду правил Центрального депозитария, приоритет имеют нормы свода правил Центрального депозитария.

Статья 3. Подача заявок и заключение сделок

1. Если по ГЦБ торговля осуществляется в чистых ценах, то при подаче заявок на покупку-продажу по таким ГЦБ торговая система автоматически осуществляет расчет доходности с учетом накопленного интереса на день Т+2.
2. При подаче заявок на покупку-продажу ГЦБ и в момент заключения по ним сделок торговая система не осуществляет проверку обеспечения.
3. По заключенным сделкам с ГЦБ по схеме Т+2 Биржа не осуществляет неттинг и клиринг.
4. Информация о заключенных сделках хранится в торговой системе до окончания дня Т+2.
5. Участники торгов уплачивают комиссионные сборы по сделкам в размере и порядке, установленном внутренним документом Биржи "Положение о членских взносах, биржевых и клиринговых сборах".

Статья 4. Сверка заключенных сделок

1. При наличии у продавца/покупателя замечаний по торговому счету в сделке он не позднее 15.00 алматинского времени дня Т+1 предоставляет Бирже посредством сообщения в торговой системе поправки по изменению номера торгового счета в сделке.
2. При получении сообщения, указанного в пункте 1 настоящей статьи, Биржа вносит необходимые изменения в торговой системе.

Статья 5. Контроль и обеспечение заключенных сделок *(данный заголовок изменен решением Совета директоров Биржи 24 сентября 2019 года)*

1. Пользователь системы контроля и обеспечения должен направить в торговую систему подтверждение сделки купли-продажи ГЦБ до 15.00 алматинского времени дня Т+1 *(данный пункт изменен решением Совета директоров Биржи 24 сентября 2019 года)*.
2. В случае если пользователем системы контроля и обеспечения сделка не подтверждена, то ответственный участник торгов до 16.00 дня Т+1 должен уведомить Биржу о намерении самостоятельно исполнить такую сделку или отказаться от исполнения данной сделки *(данный пункт изменен решением Совета директоров Биржи 24 сентября 2019 года)*.
3. Если ответственный участник готов исполнить сделку, то Биржа до окончания дня Т+1 изменяет счет пользователя системы контроля и обеспечения на собственный счет данного участника *(данный пункт изменен решением Совета директоров Биржи 24 сентября 2019 года)*.

Статья 6. Осуществление расчетов по сделкам

1. С 13.00 алматинского времени дня Т+2 торговая система в автоматизированном режиме осуществляет проверку на наличие обеспечения по каждой отдельной сделке и формирует приказы на осуществление расчетов по сделкам купли-продажи ГЦБ.
2. В случае положительного результата проверки, проведенной в соответствии с пунктом 1 настоящей статьи, торговая система в автоматизированном режиме выполняет следующие действия:

1) блокирует необходимое обеспечение на позициях в торговой системе;

2) направляет приказы на осуществление расчетов в Центральный депозитарий отдельно по каждой сделке в порядке очередности их регистрации в торговой системе.

3. После осуществления расчетов в торговую систему от Центрального депозитария поступает информационное сообщение об осуществлении таких расчетов по каждому приказу. После этого в торговой системе изменяются значения позиций участников торгов.

4. В случае отрицательного результата проверки обеспечения сделки со стороны покупателя/продавца, проведенной в соответствии с пунктом 1 настоящей статьи данный покупатель/продавец до 14.00 алматинского времени дня Т+2 устраняет причину отрицательного результата проверки либо уведомляет о ее расторжении.

   В случае если до 14.00 алматинского времени дня Т+2 покупатель не устранил причину отрицательного результата проверки или Биржа получила от него уведомление о расторжении сделки, ее исполнение осуществляется в соответствии со статьей 7 настоящего Порядка.

5. В случае если Центральным депозитарием отказано в осуществлении расчетов по сделке, после устранения причин такого отказа возможно осуществление повторных расчетов по сделке до 15.00 алматинского времени дня Т+2 при обоюдном согласии ее сторон после получения Биржей сообщений о готовности их осуществления, поданных в торговую систему Биржи каждой из сторон данной сделки.

Статья 7. Исполнение сделки за счет НБРК

1. В случае реализации события, указанного в абзаце втором пункта 4 статьи 6 настоящего Порядка (в случае отсутствия средств на счете покупателя в день валютирования сделки на вторичном рынке) и если отклонение цены сделки составляет до 5 % (включительно) от рыночной оценки ГЦБ, сделка может быть исполнена за покупателя НБРК за его собственный счет с учетом требований пунктов 2–3 настоящей статьи.

2. В случаях, предусмотренных пунктом 1 настоящей статьи, для исполнения сделки НБРК Биржа направляет ему запрос о возможности исполнения данной сделки НБРК.

3. В случае согласия исполнить сделку НБРК не позднее 16.30 алматинского времени дня Т+2 направляет уведомление о таком согласии Бирже, после чего Биржа изменяет счет участника торгов, являющегося покупателем, не исполнившим обязательство по сделке, на собственный счет НБРК. Исполнение сделки осуществляется в соответствии с пунктами 1–3 статьи 6 настоящего Порядка. Биржа по итогам торгов оформляет и предоставляет НБРК биржевое свидетельство по данной сделке.

Статья 8. Ответственность за неисполнение сделок

1. Сделка признается расторгнутой в соответствии с требованиями настоящего Порядка, в том числе если:

   1) в соответствии с требованиями пункта 3 статьи 5 настоящего Порядка если ответственный участник не готов исполнить сделку или Биржа не получила от него уведомления о намерении самостоятельно исполнить такую сделку;

   2) в соответствии с требованиями абзаца первого пункта 4 статьи 6 настоящего Порядка продавец не устранил причину отрицательного

результата проверки обеспечения сделки или Биржа получила от него уведомление о расторжении сделки;

3) сделка не исполнена до окончания операционного дня Т+2 в том числе по причине:

- превышения отклонения цены сделки свыше 5 % от рыночной оценки ГЦБ;
- несогласия НБРК исполнить сделку, отклонение цены которой составляет до 5 % (включительно) от рыночной оценки ГЦБ.

2. Виновный участник торгов обязан уплатить штраф в размере 5 % от суммы расторгнутой сделки пострадавшему участнику торгов.
3. В случае если после проведения проверки на наличие обеспечения по сделке согласно пункту 1 статьи 6 настоящего Порядка обеспечения недостаточно, то виновный участник обязан уплатить штраф в размере 50-кратного размера месячного расчетного показателя в пользу Биржи.
4. Если сделка исполнена за счет НБРК согласно статье 7 настоящего Порядка, виновный участник обязан уплатить штраф в размере 5 % от суммы неисполненной им сделки в пользу НБРК.
5. В случае осуществления повторных расчетов по неисполненной сделке к виновному участнику торгов применяется штраф в размере 50-кратного размера месячного расчетного показателя в пользу Биржи.
6. К НБРК и маркет-мейкерам не применяются штрафы, предусмотренные в пунктах 3 и 5 настоящей статьи.
7. В соответствии со статьей 11 Положения о членстве член Биржи может быть отстранен решением Правления от участия в торгах всеми или отдельными финансовыми инструментами за неисполнение и/или ненадлежащее исполнение обязательств по заключенным сделкам и/или неуплату в полном объеме штрафа, начисленного в соответствии с внутренними документами Биржи за неисполнение и/или ненадлежащее исполнение обязательств по сделкам.

Статья 9. Порядок уплаты штрафов

1. При расторжении сделки виновный участник торгов обязан уплатить Бирже полную сумму комиссионных сборов по неисполненной сделке, рассчитанную на обе стороны такой сделки, в соответствии с условиями, которые установлены внутренними документами Биржи, и без учета каких-либо льгот, предоставляемых по уплате комиссионных сборов Биржи.
2. Биржа в срок не позднее второго рабочего дня, следующего за днем расторжения сделки, уведомляет виновного участника торгов о необходимости уплатить штраф и предъявляет счет для его уплаты.
3. Виновный участник торгов перечисляет на корреспондентский счет Биржи в НБРК сумму штрафа в срок не позднее пятого рабочего дня, следующего за днем получения уведомления, предусмотренного пунктом 2 настоящей статьи.
4. Биржа в течение двух рабочих дней, следующих за днем поступления суммы штрафа на ее корреспондентский счет согласно пункту 3 настоящей статьи, переводит данную сумму НБРК или пострадавшему участнику торгов по реквизитам, предоставленным НБРК или пострадавшим участником.
5. Порядок рассмотрения разногласий по вопросам уплаты штрафа, возникающих в процессе совершения сделок с финансовыми инструментами, предусмотрен отдельным внутренним документом Биржи

"Порядок разрешения споров и конфликтов, возникающих в процессе осуществления сделок с финансовыми инструментами"[2].

Статья 10. Заключительные положения

1. Настоящий Порядок подлежит опубликованию на интернет-сайте Биржи.
2. Ответственность за своевременное внесение изменений в настоящий Порядок изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на структурное подразделение ответственное за организацию торгов.
3. Настоящий Порядок подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

Председатель Правления Алдамберген А.Ө.

[2] Утвержден решением Биржевого совета (протокол заседания от 28 мая 2012 года № 10).