

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 20 ноября 2018 года № 133)

Введен в действие

с 18 февраля 2019 года

РЕГЛАМЕНТ

торгов в торговых системах АСТ и NEXТ

(название изменено решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)

г. Алматы

2018

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 февраля 2019 года № 31);
- введены в действие с 04 марта 2019 года.

2. Дополнение № 2:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 марта 2019 года № 41);
- введено в действие с 01 апреля 2019 года.

3. Изменения и дополнения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 26 июня 2019 года № 73);
- введены в действие с 01 июля 2019 года.

4. Изменение № 4:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 30 июля 2019 года № 87);
- введено в действие с 01 августа 2019 года.

5. Изменения № 5:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 05 сентября 2019 года № 103);
- будут введены в действие отдельным решением Правления.

6. Изменения и дополнения № 6:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 09 октября 2019 года № 119);
- введены в действие с 15 октября 2019 года.

Настоящий Регламент определяет основные параметры порядка проведения торгов финансовыми инструментами, допущенными к обращению на проводимых АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) торгах (к обращению на Бирже), и работы системы контроля и обеспечения в торговых системах АСТ и NEXТ *(данная преамбула изменена решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Понятия

1. Для целей настоящего Регламента:
 - 1) под лимитом отклонения цены понимается лимит отклонения цены заявки от какой-либо величины, при достижении или превышении которого наступает определенное событие или возникает определенная ситуация в соответствии с настоящим Регламентом и другими внутренними документами Биржи, решениями Совета директоров Биржи или Правления Биржи, настройками торговой системы;
 - 2) под операционным днем понимается часть рабочего дня, в течение которой Биржей осуществляются процедуры по организации и администрированию торгов, клирингу и расчетам по сделкам с финансовыми инструментами;
 - 3) под финансовыми инструментами понимаются только те из них, которые допущены к обращению на Бирже;
 - 4) под торгами понимаются торги, проводимые Биржей;
 - 5) под сделками понимаются сделки с финансовыми инструментами, заключенные на торгах;
 - 6) под заявками понимаются заявки на заключение сделок;
 - 7) под акциями первого (либо второго или третьего) класса ликвидности и не вошедших в список Т+ в соответствии с внутренним документом Биржи "Порядок включения финансовых инструментов в Список Т+ и в Список обеспечения Т+ понимаются акции, которые включены в действующий в список¹ ценных бумаг первого (либо второго или третьего) класса ликвидности *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*;
 - 8) под рабочим днем РК понимается исключительно день, который является рабочим в Республике Казахстан;
 - 9) под нерабочим днем понимается рабочий день РК, в который по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи не осуществляют расчеты по соответствующим иностранным валютам и тенге *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года)*;
 - 10) под твердой котировкой понимается котировка, накладывающая на объявившего ее участника торгов обязательство заключить сделку на основании данной котировки *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года)*;
2. Иные понятия и термины, используемые в настоящем Регламенте, определяются в соответствии с законодательством Республики Казахстан

¹ Списки ценных бумаг различных классов ликвидности формируются в соответствии с Методикой определения показателей ликвидности ценных бумаг.

и внутренним документом Биржи "Правила осуществления биржевой деятельности"².

Статья 2. Понятие регламента торгов

1. Под регламентом торгов понимаются основные параметры их проведения, включающие в себя:
 - 1) место проведения торгов;
 - 2) время проведения торгов;
 - 3) основной метод проведения торгов;
 - 4) размер лота;
 - 5) единица измерения цены финансового инструмента;
 - 6) цена открытия торговой сессии;
 - 7) лимит отклонения цены;
 - 8) дополнительный метод проведения торгов;
 - 9) резервный метод проведения торгов;
 - 10) особые условия и ограничения применения основных параметров проведения торгов.
2. Место проведения торгов определяется статьей 3 настоящего Регламента.
3. Время проведения торгов определяется статьей 4 и главами 2–8 настоящего Регламента.
4. Основной метод проведения торгов определяется статьей 7 настоящего Регламента.
5. Размеры лотов (с учетом особенности, установленной абзацем вторым настоящего пункта), единицы измерения цены финансовых инструментов, цена открытия торговых сессий, дополнительные и резервные методы проведения торгов определяются главами 2–8 настоящего Регламента.

При проведении торгов методом заключения прямых сделок понятие "лот" не применяется; размеры заявок и, соответственно, сделок определяются участниками торгов самостоятельно по согласованию друг с другом.

Статья 3. Место проведения торгов

1. Основным местом проведения торгов является торговая система, работа с которой осуществляется в режиме удаленного доступа (в том числе с использованием программно-криптографических средств защиты информации) (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).
2. В случае невозможности проведения торгов в торговой системе они проводятся голосовым способом в месте, определенном в этих целях Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).
3. Члены Биржи – участники торгов извещаются об изменении места их проведения через торговую систему и иными возможными способами таким образом, чтобы обеспечить такое извещение членов Биржи – участников торгов до начала торгов по новому месту их проведения.

² Утверждены решением Совета директоров АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 14 декабря 2017 года № 30).

Статья 4. Время проведения торгов

1. Торги проводятся каждый рабочий день РК в течение торгового дня, отдельно устанавливаемого главами 2–9 настоящего Регламента для каждой группы финансовых инструментов (за исключением, установленным абзацем вторым настоящего пункта).

Торговый день по финансовым инструментам, являющимся предметом торгов с единственным продавцом или покупателем финансового инструмента (как эти торги определены внутренним документом Биржи "Положение о членских взносах и биржевых сборах"), может отличаться от торгового дня, установленного для группы финансовых инструментов, к которой относится данный предмет торгов.

2. Торговый день по иностранным валютам подразделяется на отдельные торговые сессии, определенные статьей 10 настоящего Регламента.

Торговые дни по иным, чем иностранные валюты, финансовым инструментам на отдельные торговые сессии не подразделяются; торги такими финансовыми инструментами проводятся в одну торговую сессию, совпадающую по своей продолжительности с торговым днем.

3. Время проведения торгов отдельным финансовым инструментом или группой финансовых инструментов может быть изменено распоряжением Председателя Правления Биржи или заместителя Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в следующих случаях:

- 1) сбой в работе программно-технических средств, используемых при проведении торгов, или возникновение иных непредвиденных обстоятельств, препятствующих проведению торгов в обычном режиме;
- 2) изменение места проведения торгов в соответствии с пунктом 2 статьи 3 настоящего Регламента;
- 3) поступление распоряжения от Национального Банка Республики Казахстан;
- 4) поступление от инициатора допуска финансового инструмента письменного заявления произвольной формы об открытии торгов данным финансовым инструментом с указанием предпочтительного времени открытия торгов данным финансовым инструментом в пределах времени торгового дня по финансовым инструментам данной группы;
- 5) поступление от участника торгов письменного заявления о продлении торгов отдельными финансовыми инструментами в целях закрытия данным участником торгов ранее открытых позиций и/или исполнения обязательств по ранее заключенным сделкам с этими финансовыми инструментами. Заявление должно содержать сведения о предполагаемом времени продления торгов, описание причин продления торгов.

4. Члены Биржи – участники торгов извещаются об изменении времени их проведения через торговую систему и иными возможными способами.

Статья 5. Операционный день Биржи

1. Операционный день Биржи начинается в 09.00 алматинского времени для всех групп финансовых инструментов с учетом особенностей, установленных пунктом 3 и подпунктом 1) пункта 4 настоящей статьи.

2. Операционный день Биржи заканчивается в 19.15 алматинского времени с учетом особенностей, установленных пунктом 3 и подпунктом 2) пункта 4 настоящей статьи (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).
3. Время окончания операционного дня может быть изменено (операционный день Биржи может быть продлен) Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в следующих случаях:
 - 1) сбой в работе программно-технических средств Биржи, используемых при осуществлении клиринга и расчетов по финансовым инструментам, или возникновение иных непредвиденных обстоятельств, препятствующих осуществлению Биржей клиринга и расчетов по финансовым инструментам в обычном режиме;
 - 2) продление торгового дня в соответствии с пунктом 3 статьи 4 настоящего Регламента;
 - 3) поступление на Биржу от участника торгов письменного заявления в произвольной форме о продлении операционного дня с указанием причин и времени такого продления;
 - 4) поступление на Биржу от Центрального депозитария по электронной почте или иными возможными видами связи сообщения о продлении его операционного дня;
 - 5) продление операционного дня для целей завершения клиринга в случае дефолта.
4. Порядок открытия и закрытия операционного дня Биржи для фондового рынка:
 - 1) операционный день Биржи считается открытым при исполнении следующих действий: до 9.15 алматинского времени Биржа направляет в Центральный депозитарий запрос об остатках денег и ценных бумаг на торговых счетах участников торгов, в ответ на который Центральный депозитарий направляет Бирже запрашиваемые сведения;
 - 2) операционный день Биржи считается закрытым при исполнении следующих действий: в 19.15 алматинского времени Биржа направляет в Центральный депозитарий запрос о закрытии операционного дня, в ответ на который Центральный депозитарий направляет сообщение с ответом о возможности закрытия операционного дня с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).

Статья 6. Ограничение времени заключения повторных сделок

В случае если внутренними документами Биржи разрешено заключение повторных (в том числе и дублирующих повторных) сделок взамен и на условиях ранее заключенных, но не исполненных сделок, то такие повторные сделки могут заключаться и по истечении времени проведения торгов соответствующими финансовыми инструментами, но лишь до истечения времени работы системы контроля и обеспечения (*данный абзац изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).

Статья 7. Основной метод проведения торгов

1. Если иное не установлено главами 2–8 настоящего Регламента и другими внутренними документами Биржи для отдельных групп финансовых

инструментов, основным методом проведения торгов является метод непрерывного встречного аукциона.

1-1. Торги по инструменту USDKZТ_TOM, проводимые методом непрерывного встречного аукциона, в любое время торгового дня, но не позднее, чем за семь минут до его окончания проводятся методом франкфуртских торгов в случае если при *(данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:

- 1) совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку цена предполагаемой сделки отличается от цены последней сделки предыдущего торгового дня по данному инструменту на 1,5 % и более;
- 2) повторном совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку цена предполагаемой сделки отличается от цены отсечения, сложившейся на последних франкфуртских торгах текущего торгового дня по данному инструменту, на 1,5 % и более.

1-2. При переводе торгов по инструменту USDKZТ_TOM, проводимых в торговой системе методом непрерывного встречного аукциона, в режим ожидания *(данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:

- 1) минимальная продолжительность режима ожидания составляет шесть минут, максимальная – семь минут (с учетом особенностей, установленных подпунктами 2) и 3) настоящего пункта;
- 2) продолжительность режима ожидания составляет шесть минут, в случае если до истечения шестой минуты режима ожидания не было принято и/или аннулировано ни одной заявки;
- 3) продолжительность режима ожидания составляет от шести до семи минут и заканчивается в пределах указанного временного промежутка в произвольный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, в случае если до истечения шестой минуты режима ожидания была принята хоть одна дополнительная заявка и/или аннулирована какая-либо заявка.

2. При проведении торгов методом непрерывного встречного аукциона внутренними документами Биржи или настройками торговой системы может быть установлена возможность подачи предварительных заявок, то есть заявок, принимаемых Биржей до начала торговой сессии.

Прием Биржей предварительных заявок начинается в 11.05 алматинского времени дня проведения торгов.

Подача предварительной заявки может быть осуществлена автоматическим способом путем подачи участником торгов такой заявки с указанием возможности ежедневного формирования предварительной заявки.

В течение срока действия предварительной заявки ежедневно с 11.05 алматинского времени в торговой системе Биржи автоматическим способом формируется предварительная заявка на покупку и/или на продажу финансового инструмента.

Биржа оставляет за собой право прекратить формирование автоматическим способом предварительных заявок на покупку и/или на продажу данного финансового инструмента в случаях изменения вида цены (с грязной на чистую или наоборот) при проведении торгов данным финансовым инструментом; изменения свойств и параметров данного финансового инструмента, если такие изменения способны существенно повлиять на ценообразование по данному финансовому инструменту (например, при дроблении ценной бумаги).

Биржа обязана уведомить участника торгов, подавшего предварительную заявку на покупку и/или на продажу данного финансового инструмента, о прекращении ежедневного формирования предварительных заявок в соответствии с абзацем третьим настоящего пункта посредством отправки соответствующего сообщения через торговую систему.

В случае осуществления проверки обеспечения заявок участников торгов, установленного иными внутренними документами Биржи, проверка обеспечения предварительных заявок осуществляется в момент их подачи в торговую систему, в том числе автоматическим способом.

В случае получения Биржей официального документа от уполномоченного органа о приостановлении или отзыве лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг у какого-либо члена Биржи Департамент торгов прекращает формирование автоматическим способом предварительных заявок на покупку и/или на продажу финансовых инструментов и/или исключает из торговой системы действующие заявки, поданные данным членом Биржи.

3. Торги облигациями, проводимые методом непрерывного встречного аукциона, переводятся в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*):
 - 1) в случае совпадения или пересечения цен, указанных во встречных заявках на продажу и покупку облигаций, допущенных к обращению на Бирже;
 - 2) в случае совпадения или пересечения цен, указанных в предварительных встречных заявках на продажу и покупку.
4. При переводе торгов ценными бумагами, проводимых в торговой системе методом непрерывного встречного аукциона, в режим ожидания (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года*):
 - 1) минимальная продолжительность режима ожидания составляет 10 минут, максимальная – 20 минут (с учетом особенности, установленной подпунктом 3) настоящего пункта);
 - 2) режим ожидания заканчивается не ранее чем по истечении пяти минут с момента (с учетом ограничения продолжительности торговой сессии, установленной настоящим Регламентом, максимальной продолжительности режима ожидания, установленной подпунктом 1) настоящего пункта, и особенности, установленной подпунктом 3) настоящего пункта):
 - приема Биржей последней заявки, поданной во время нахождения торгов в режиме ожидания;
 - последнего аннулирования какой-либо заявки, поданной во время нахождения торгов в режиме ожидания;
 - последнего изменения условий какой-либо заявки, поданной во время нахождения торгов в режиме ожидания;
 - 3) в случае если продолжительность режима ожидания, определенная согласно подпунктам 1) и 2) настоящего пункта, составляет от 11 до 18 минут, режим ожидания заканчивается точно в соответствии с этой продолжительностью;
 - в случае если продолжительность режима ожидания, определенная согласно подпунктам 1) и 2) настоящего пункта, составляет от 18 до 20 минут, режим ожидания заканчивается в пределах указанного временного промежутка в произвольный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел.

5. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года).*
6. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года).*

Статья 8. Лимиты отклонения цен

1. Лимиты отклонения цен подразделяются на:
 - 1) предупредительные;
 - 2) преодолимые;
 - 3) жесткие (непреодолимые).
2. Предупредительные лимиты отклонения цен устанавливаются настройками торговой системы во избежание технических ошибок участников торгов при наборе заявок и их вводе в торговую систему.

В случае если параметры заявки, вводимой в торговую систему, сопряжены с нарушением какого-либо предупредительного лимита отклонения цены, торговая система выдает соответствующее предупреждающее сообщение, которое может быть проигнорировано участником торгов, подающим данную заявку, или использовано им для коррекции данной заявки.

3. Преодолимые лимиты отклонения цен устанавливаются в торговой системе на основании требований настоящего Регламента, решений Совета директоров или Правления Биржи во избежание технических ошибок участников торгов при наборе заявок и их вводе в торговую систему либо в иных целях.

В случае если параметры заявки, вводимой в торговую систему, сопряжены с нарушением какого-либо преодолимого лимита отклонения цены, торговая система отклоняет данную заявку (отказывает в приеме данной заявки) и выдает соответствующее сообщение.

При осознанной необходимости превышения указанного лимита заинтересованный участник торгов вправе обратиться к маклеру Биржи или лицу, его замещающему, с просьбой снять или увеличить указанный лимит. Маклер Биржи не имеет права отказать в удовлетворении такой просьбы, но обязан посредством торговой системы предварительно известить других участников торгов о снятии или увеличении указанного лимита.

4. Жесткие (непреодолимые) лимиты отклонения цен могут устанавливаться в торговой системе на основании решений Совета директоров или Правления Биржи в целях установления допустимого диапазона цен заявок либо в иных целях.

В случае если параметры заявки, вводимой в торговую систему, сопряжены с нарушением какого-либо жесткого (непреодолимого) лимита отклонения цены, торговая система отклоняет данную заявку (отказывает в приеме данной заявки) и выдает соответствующее сообщение.

Маклер Биржи не имеет права снять или увеличить жесткий лимит без соответствующего разрешения органа Биржи, на основании решения которого был установлен указанный лимит.

5. Установленные преодолимые и жесткие (непреодолимые) лимиты отклонения цен приведены в главах 2–5 настоящего Регламента.

Статья 9. Последствия возникновения обстоятельств непреодолимой силы

Председатель Правления Биржи или заместитель Председателя Правления Биржи, курирующий проведение торгов, вправе установить иные, чем

определенные настоящим Регламентом, основные параметры порядка проведения торгов и работы системы контроля и обеспечения Биржи в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы, препятствующих обращению финансовых инструментов на Бирже в обычном режиме, и под которыми понимаются любые чрезвычайные и непредотвратимые при данных условиях обстоятельства, не поддающиеся разумному контролю со стороны Биржи, включая, но не ограничиваясь только перечисленным, войну, военные или террористические действия, действия государственных органов, государственный переворот, пожар, стихийные бедствия и другие обстоятельства, которые Биржа не могла предвидеть и которые непосредственно повлияли на возможность заключения и исполнения сделок в обычном режиме (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).

Глава 2. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ИНОСТРАННЫМИ ВАЛЮТАМИ

Статья 10. Торговый день

1. Торговый день по иностранным валютам начинается в 10.15 алматинского времени, заканчивается в 17.00 алматинского времени (с учетом условий, установленных пунктами 1-1 и 1-2 статьи 7 настоящего Регламента) и подразделяется на торги (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года*):
 - 1) с иностранными валютами со сроком осуществления расчетов в день торгов (с учетом особенности, установленной подпунктом 2) настоящего пункта) – с 10.15 до 15.30 алматинского времени;
 - 2) с китайским юанем со сроком осуществления расчетов в день торгов и операциям валютного свопа в отношении китайского юаня – с 10.15 до 11.00 алматинского времени;
 - 3) с иностранными валютами со сроком осуществления расчетов на следующий рабочий день или на второй рабочий день после дня торгов – с 10.15 до 17.00 алматинского времени;
 - 4) по операциям валютного свопа в отношении евро и рубля – с 11.30 до 15.30 алматинского времени (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года*);
2. Торговый день по операциям валютного свопа в отношении доллара США начинается в 11.30 алматинского времени, заканчивается в 17.30 алматинского времени и подразделяется на следующие торговые сессии (*данный пункт включен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года*):
 - 1) основная сессия – с 11.30 до 15.30 алматинского времени;
 - 2) дополнительная сессия – с 17.00 до 17.30 алматинского времени.

Статья 11. Частные параметры проведения торгов долларом США

1. Доллар США торгуется с расчетами в тенге и сроками осуществления расчетов T+0³, T+1 и T+2 (далее обозначается соответственно как "USDKZT_TOD", "USDKZT_TOM" и "USDKZT_SPT"⁴).

³ Общепринятое в мировой практике обозначение сроков осуществления расчетов по биржевым сделкам (исполнения биржевых сделок) в виде записи "T+n", где T – день биржевых торгов, на которых заключена сделка, а n – длительность перерыва между указанным днем биржевых торгов и днем осуществления расчетов по этой сделке (в рабочих днях).

(Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).

2. *(Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

Торги USDKZT_TOD не проводятся в случае, если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты (далее – нерабочий день) в долларах США в день торгов.

3. В случае если день исполнения сделок по инструменту USDKZT_TOM (день T+1) либо USDKZT_SPT (день T+2) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по доллару США нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в долларах США и в тенге, следующий за нерабочим днем *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

В случае если по инструменту USDKZT_SPT день T+1 и день T+2 по каким-либо причинам являются для банков – корреспондентов Биржи по доллару США нерабочими днями, то соответствующие дни T+1 и T+2 переносятся на следующие рабочие дни РК.

4. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*
5. Размер лота при проведении торгов долларом США зависит от величины отклонения цены поданной заявки от цены последней сделки и установлен приложением 1 к настоящему Регламенту.
6. При проведении торгов долларом США его цена измеряется в казахстанских тенге за один доллар США с точностью до второго знака после запятой.
7. В качестве цены открытия торговой сессии по USDKZT_TOD, USDKZT_TOM или USDKZT_SPT используется цена первой сделки, заключенной с USDKZT_TOD, USDKZT_TOM или USDKZT_SPT соответственно на данной торговой сессии.
8. При проведении торгов долларом США преодолимый лимит отклонения цены не установлен *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*
9. Дополнительные методы проведения торгов долларом США не установлены.

Резервным методом проведения торгов долларом США (вне зависимости от сроков расчетов) является метод фиксинга.

Статья 12. Частные параметры проведения торгов евро

1. Евро торгуется с расчетами в тенге и долларах США и сроками осуществления расчетов T+0, T+1 и T+2.

Евро с расчетами в тенге и указанными сроками осуществления расчетов далее обозначается соответственно как "EURKZT_TOD", "EURKZT_TOM" и "EURKZT_SPT"⁴.

Евро с расчетами в долларах США и указанными сроками осуществления расчетов далее обозначается соответственно как "EURUSD_TOD", "EURUSD_TOM" и "EURUSD_SPT"⁴.

⁴ См. Инструкцию о порядке кодировки членов АО "Казахстанская фондовая биржа" и их счетов, финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг, утвержденную решением Правления Биржи от 01 марта 2017 года № 21.

2. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*
3. Торги EURKZT_TOD не проводятся в случае, если по каким-либо причинам день торгов является для банков – корреспондентов Биржи по евро нерабочим днем.

Торги EURUSD_TOD не проводятся в случае, если день торгов по каким-либо причинам является для любого или всех соответствующих банков – корреспондентов Биржи по доллару США и/или евро нерабочим днем.
4. *(Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

В случае если день исполнения сделок по инструменту EURKZT_TOM (день T+1) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по евро нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в евро и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если день исполнения сделок по инструменту EURUSD_TOM (день T+1) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по доллару США и/или евро нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в долларах США и/или евро, следующий за нерабочим днем.

В случае если день исполнения сделок по инструменту EURKZT_SPT (день T+2) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по евро нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в евро и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если по инструменту EURKZT_SPT день T+1 и день T+2 по каким-либо причинам являются для банков – корреспондентов Биржи по евро нерабочими днями, то соответствующие дни T+1 и T+2 переносятся на следующие рабочие дни РК.

В случае если день исполнения сделок по инструменту EURUSD_SPT (день T+2) по каким-либо причинам является для любого или всех соответствующих банков – корреспондентов Биржи по доллару США и/или в евро нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в долларах США и евро, следующий за нерабочим днем.

В случае если по инструменту EURUSD_SPT день T+1 и день T+2 по каким-либо причинам являются для банков – корреспондентов Биржи по доллару США или евро нерабочими днями, то соответствующие дни T+1 и T+2 переносятся на следующие рабочие дни РК.
5. Размер лота при проведении торгов евро составляет 1.000 евро *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 февраля 2019 года).*
6. При проведении торгов евро его цена измеряется в той валюте, в которой осуществляются расчеты, за один евро:
 - 1) по EURKZT_TOD, EURKZT_TOM и EURKZT_SPT – в тенге с точностью до второго знака после запятой;
 - 2) по EURUSD_TOD, EURUSD_TOM и EURUSD_SPT – в долларах США с точностью до четвертого знака после запятой.
7. В качестве цены открытия торговой сессии по каждому из инструментов – EURKZT_TOD, EURKZT_TOM, EURKZT_SPT, EURUSD_TOD,

EURUSD_TOM и EURUSD_SPT – используется цена первой сделки, заключенной на этой торговой сессии с данным инструментом.

8. При проведении торгов евро установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 3 % от цены последней сделки.
9. Дополнительные методы проведения торгов евро не установлены.
Резервным методом проведения торгов евро является метод фиксинга.

Статья 13. Частные параметры проведения торгов российским рублем

1. Российский рубль торгуется с расчетами в тенге и сроками осуществления расчетов T+0, T+1 и T+2 (далее обозначается соответственно как "RUBKZT_TOD", "RUBKZT_TOM" и "RUBKZT_SPT").

2. *(Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

Торги RUBKZT_TOD не проводятся в случае, если день торгов по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по рублю нерабочим днем.

3. *(Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

В случае если день исполнения сделок по инструменту RUBKZT_TOM (день T+1) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по рублю нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в рублях и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если день исполнения сделок по инструменту RUBKZT_SPT (день T+2) по каким-либо причинам является для банков - корреспондентов Биржи по рублю нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в рублях и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если по инструменту RUBKZT_SPT день T+1 и день T+2 по каким-либо причинам являются для банков – корреспондентов Биржи по рублю нерабочими днями, то соответствующие дни T+1 и T+2 переносятся на следующие рабочие дни РК.

4. Размер лота при проведении торгов российским рублем составляет 50.000 российских рублей *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 февраля 2019 года).*
5. При проведении торгов российским рублем его цена измеряется в казахстанских тенге за один российский рубль с точностью до четвертого знака после запятой.
6. В качестве цены открытия торговой сессии по российскому рублю используется цена первой сделки, заключенной на данной торговой сессии.
7. Для российского рубля установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 3 % от цены последней сделки.
8. Дополнительные методы проведения торгов российским рублем не установлены.

Резервным методом проведения торгов российским рублем является метод фиксинга.

Статья 14. Частные параметры проведения торгов юанем Китайской Народной Республики

1. Юань Китайской Народной Республики (далее – юань) торгуется с расчетами в тенге и сроками осуществления расчетов T+0, T+1 и T+2 (далее обозначается соответственно как "CNYKZT_TOD", "CNYKZT_TOM" и "CNYKZT_SPT").
2. Торги CNYKZT_TOD, CNYKZT_TOM и CNYKZT_SPT не проводятся в случае, если по каким-либо причинам день торгов является для банков – корреспондентов Биржи по юаню нерабочим днем (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года*).
3. (*Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года*).

В случае если день исполнения сделок по инструменту CNYKZT_TOM (день T+1) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по юаню нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в юанях и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если день исполнения сделок по инструменту CNYKZT_SPT (день T+2) по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по юаню нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день РК, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в юанях и в тенге, следующий за нерабочим днем.

В случае если по инструменту CNYKZT_SPT день T+1 и день T+2 по каким-либо причинам являются для банков – корреспондентов Биржи по юаню нерабочими днями, то соответствующие дни T+1 и T+2 переносятся на следующие рабочие дни РК.

4. Размер лота при проведении торгов юанем составляет 5 000 юаней (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 февраля 2019 года*).
5. При проведении торгов юанем его цена измеряется в казахстанских тенге за один юань с точностью до четвертого знака после запятой.
6. В качестве цены открытия торговой сессии по юаню используется цена первой сделки, заключенной на данной торговой сессии.
7. Для юаня установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 3 % от цены последней сделки.
8. Дополнительные методы проведения торгов юанем не установлены.
Резервным методом проведения торгов юанем является метод фиксинга.

Статья 15. Частные параметры проведения торгов иностранными валютами в части операций валютного свопа

1. Операции валютного свопа осуществляются в отношении доллара США как предмета этих операций и включают следующие виды сделок:
 - 1) сделки с USDKZT_TOD или USDKZT_TOM как сделки с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи;

- 2) сделки с USDKZT_TOM, USDKZT_SPT, USDKZT_01W⁵, USDKZT_01M, USDKZT_03M, USDKZT_06M или USDKZT_01Y как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа) *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 28 марта 2019 года)*.
- 1-1. На дополнительной сессии *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года)*:
- 1) осуществляются операции валютного свопа в отношении доллара США только с Национальным Банком Республики Казахстан;
 - 2) операции валютного свопа осуществляются со сроком исполнения один день;
 - 3) в случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США в день торгов:
торги USDKZT_0_001 не проводятся;
проводятся торги операциями валютного свопа с более поздним сроком осуществления расчетов – USDKZT_1_002;
 - 4) участие в торгах могут принимать банки второго уровня, являющиеся клиринговыми участниками валютного рынка;
 - 5) Национальный Банк Республики Казахстан объявляет твердые котировки, иные участники торгов вправе заключать сделки только по котировкам, объявленным Национальным Банком Республики Казахстан.
2. Операции валютного свопа осуществляются в отношении евро как предмета этих операций и включают следующие виды сделок:
- 1) сделки с EURKZT_TOD или EURKZT_TOM как сделки с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи);
 - 2) сделки с EURKZT_TOM или EURKZT_SPT как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).
3. Сделки с USDKZT_TOM и EURKZT_TOM могут использоваться для начала (открытия) операций валютного свопа только в случае, если в день такого начала (открытия) торги соответственно по USDKZT_TOD и EURKZT_TOD не проводятся.
4. Операции валютного свопа осуществляются в отношении рубля как предмета этих операций и включают следующие виды сделок:
- 1) сделки с RUBKZT_TOD или RUBKZT_TOM как сделки с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 5 настоящей статьи);
 - 2) сделки с RUBKZT_TOM или RUBKZT_SPT как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).

⁵ См. Инструкцию о порядке кодировки членов АО "Казахстанская фондовая биржа" и их счетов, финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг, утвержденную решением Правления Биржи от 01 марта 2017 года № 21.

5. Сделки с RUBKZT_TOM могут использоваться для начала (открытия) операций валютного свопа только в случае, если в день такого начала (открытия) торги соответственно по RUBKZT_TOD не проводятся.
6. Операции валютного свопа осуществляются в отношении юаня как предмета этих операций и включают следующие виды сделок:
 - 1) сделки с CNYKZT_TOD или CNYKZT_TOM как сделки с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа);
 - 2) сделки с CNYKZT_TOM или CNYKZT_SPT как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).
7. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*
8. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*
9. Размер лота при осуществлении операций валютного свопа составляет 10.000 единиц валюты, являющейся предметом операции валютного свопа *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 30 июля 2019 года).*
10. При осуществлении операций валютного свопа цена такой операции (в качестве которой используется доходность операции своп) измеряется в процентах годовых с точностью до четвертого знака после запятой.
11. В качестве цены открытия торговой сессии при осуществлении операций валютного свопа какого-либо состава используется цена первой операции валютного свопа этого состава, начатой (открытой) на данной торговой сессии.
12. Дополнительные методы проведения торгов при осуществлении операций валютного свопа не установлены.

Резервным методом проведения торгов при осуществлении операций валютного свопа является метод фиксинга.

Глава 3. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ГОСУДАРСТВЕННЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ РЕСПУБЛИКИ КАЗАХСТАН

Статья 16. Торговый день

Торговый день по государственным ценным бумагам Республики Казахстан начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени.

Статья 17. Ограничение на применение метода заключения прямых сделок

Запрещено проведение торгов государственными ценными бумагами Республики Казахстан методом заключения прямых сделок, за исключением торгов международными ценными бумагами Республики Казахстан.

Статья 18. Лимиты отклонения цен по государственным ценным бумагам Республики Казахстан

Решением Биржевого совета (протокол заседания от 26 декабря 2007 года № 34) по государственным ценным бумагам Республики Казахстан любого наименования установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 30 % от цены последней сделки с ценными бумагами данного наименования (до заключения первой по очередности сделки – от средневзвешенной цены всех сделок с ценными бумагами данного наименования, заключенных на последней результативной торговой сессии). При этом заинтересованный участник торгов вправе обратиться к маклеру Биржи с просьбой снять или увеличить указанный лимит не менее чем за 15 минут до окончания торговой сессии.

Статья 19. Частные параметры проведения торгов международными ценными бумагами Республики Казахстан

1. Размер лота при проведении торгов международными ценными бумагами Республики Казахстан (далее в настоящей статье – еврооблигации) не устанавливается.
2. Торги еврооблигациями какого-либо наименования проводятся *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:
в "чистых" ценах, если еврооблигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту;
либо
в "грязных" ценах, если еврооблигации данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.
3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо еврооблигациям используется цена первой сделки с этими еврооблигациями, заключенной на данной торговой сессии.
4. Дополнительным методом проведения торгов еврооблигациями является метод заключения прямых сделок.
Резервным методом проведения торгов еврооблигациями является метод фиксинга.

Статья 20. Частные параметры торгов ценными бумагами Правительства, Национального Банка Республики Казахстан⁶ и местных исполнительных органов

1. Размер лота при проведении торгов ценными бумагами Правительства, Национального Банка Республики Казахстан и местных исполнительных органов (далее в настоящей статье – государственные облигации) не устанавливается.
2. Торги государственными облигациями какого-либо наименования проводятся *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:
в "чистых" ценах, если государственные облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту;
либо

⁶ Кроме международных ценных бумаг Республики Казахстан, частные параметры проведения торгов которыми установлен статьей 17 настоящего Регламента.

в "грязных" ценах, если государственные облигации данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо государственным облигациям используется цена первой сделки с этими государственными облигациями, заключенной на данной торговой сессии.
4. Дополнительные методы проведения торгов государственными облигациями не установлены (исходя из ограничения, указанного в статье 15 настоящего Регламента).

Резервным методом торгов государственными облигациями является метод фиксинга.

Глава 4. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НЕГОСУДАРСТВЕННЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 21. Торговый день

Торговый день по негосударственным ценным бумагам начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).

Статья 22. Лимиты отклонения цен по негосударственным ценным бумагам

Решением Биржевого совета (протокол заседания от 26 декабря 2007 года № 34) по негосударственным ценным бумагам любого наименования (за исключением ценных бумаг, входящих в продаваемые через Биржу государственные пакеты акций) установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 30 % от цены последней сделки с ценными бумагами данного наименования (до заключения первой по очередности сделки – от средневзвешенной цены всех сделок с ценными бумагами данного наименования, заключенных на последней результативной торговой сессии). При этом заинтересованный участник торгов вправе обратиться к маклеру Биржи с просьбой снять или увеличить указанный лимит не менее чем за 15 минут до окончания торговой сессии.

Статья 23. Частные параметры проведения торгов акциями

Если иное не установлено решением Правления Биржи в отношении акций какого-либо отдельного наименования, акции используются только в качестве предметов операций репо, осуществляемых "прямым" способом (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*).

Статья 24. Частные параметры проведения торгов облигациями, включенными в официальный список Биржи

1. Размер лота при проведении торгов облигациями, включенными в официальный список Биржи (далее в настоящей статье – листинговые облигации), не устанавливается.
2. Торги листинговыми облигациями какого-либо наименования проводятся (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года*):

в "чистых" ценах, если листинговые облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту;

либо

в "грязных" ценах, если листинговые облигации данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.

Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля листинговыми облигациями какого-либо наименования, определяются решениями Правления Биржи, принимаемыми в связи с открытием торгов облигациями данного наименования.

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо листинговым облигациям используется цена первой сделки с этими листинговыми облигациями, заключенной на данной торговой сессии.

- 3-1. Торги облигациями, номинированными в долларах США, сделки по которым рассчитываются в данной валюте, не проводятся за два торговых дня до дня, в который по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США *(данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*.

4. Дополнительным методом проведения торгов листинговыми облигациями является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов листинговыми облигациями является метод фиксинга.

Статья 25. Частные параметры проведения торгов облигациями, допущенными к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги"

1. Размер лота при проведении торгов облигациями, допущенными к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги" (далее в настоящей статье – нелистинговые облигации), не устанавливается.

2. Торги нелистинговыми облигациями какого-либо наименования проводятся: в "чистых" ценах, если нелистинговые облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:

либо

в "грязных" ценах, если нелистинговые облигации данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.

Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля нелистинговыми облигациями какого-либо наименования, определяются решениями Правления Биржи, принимаемыми в связи с допуском облигаций данного наименования к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги".

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо нелистинговым облигациям используется цена первой сделки с этими нелистинговыми облигациями, заключенной на данной торговой сессии.

4. Дополнительным методом проведения торгов нелистинговыми облигациями является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов нелистинговыми облигациями является метод фиксинга.

Статья 26. Частные параметры проведения торгов государственными пакетами акций

1. Размеры лотов при проведении торгов государственными пакетами акций сообщаются Бирже продавцами данных государственных пакетов акций.
2. При проведении торгов государственными пакетами акций их цена измеряется в казахстанских тенге за одну акцию с точностью до второго знака после запятой.
3. Понятия "цена открытия" и "лимит отклонения цены" по отношению к государственным пакетам акций не применяются.
4. Методы проведения торгов государственными пакетами акций определяются продавцами данных государственных пакетов акций по согласованию с Биржей.

Глава 5. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

(Данная глава исключена решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)

Глава 6. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ И ИНОСТРАННЫМИ ГОСУДАРСТВЕННЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 30. Торговый день

Торговый день по ценным бумагам международных финансовых организаций и иностранным государственным ценным бумагам начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени.

Статья 31. Лимиты отклонения цен

Решением Биржевого совета (протокол заседания от 26 декабря 2007 года № 34) по ценным бумагам международных финансовых организаций и иностранным государственным ценным бумагам любого наименования установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 30 % от цены последней сделки с ценными бумагами данного наименования (до заключения первой по очередности сделки – от средневзвешенной цены всех сделок с ценными бумагами данного наименования, заключенных на последней результативной торговой сессии). При этом заинтересованный участник торгов вправе обратиться к маклеру Биржи с просьбой снять или увеличить указанный лимит не менее чем за 15 минут до окончания торговой сессии.

Статья 32. Частные параметры проведения торгов ценными бумагами международных финансовых организаций

1. Размер лота при проведении торгов ценными бумагами международных финансовых организаций (далее в настоящей статье – облигации МФО) не устанавливается.
2. Торги облигациями МФО какого-либо наименования проводятся *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:
в "чистых" ценах, если облигации МФО данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту;
либо

в "грязных" ценах, если облигации МФО данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.

Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля облигациями МФО какого-либо наименования, определяются решениями Правления Биржи, принимаемыми в связи с допуском облигаций данного наименования к обращению на Бирже.

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо облигациям МФО используется цена первой сделки с этими облигациями МФО, заключенной на данной торговой сессии.
4. Дополнительным методом проведения торгов облигациями МФО является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов облигациями МФО является метод фиксинга.

Статья 33. Частные параметры проведения торгов иностранными государственными ценными бумагами

1. Размер лота при проведении торгов иностранными государственными ценными бумагами (далее в настоящей статье – иностранные государственные облигации) не устанавливается.
2. Торги иностранными государственными облигациями какого-либо наименования проводятся *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:

в "чистых" ценах, если иностранные государственные облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 1 приложения 2 к настоящему Регламенту;

либо

в "грязных" ценах, если иностранные государственные облигации данного наименования соответствуют всем критериям, которые установлены пунктом 2 приложения 2 к настоящему Регламенту.

Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля иностранными государственными облигациями какого-либо наименования, определяются решениями Правления Биржи, принимаемыми в связи с допуском иностранных государственных облигаций данного наименования к обращению на Бирже.

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо иностранным государственным облигациям используется цена первой сделки с этими иностранными государственными облигациями, заключенной на данной торговой сессии.
4. Дополнительным методом проведения торгов иностранными государственными облигациями является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов иностранными государственными облигациями является метод фиксинга.

Глава 7. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ПРОИЗВОДНЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

(Данная глава исключена решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)

Глава 8. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ФЬЮЧЕРСАМИ

Статья 36. Торговый день

Торговый день по фьючерсам начинается в 10.00 алматинского времени и заканчивается в 15.30 алматинского времени.

Статья 37. Частные параметры проведения торгов фьючерсами

Частные параметры проведения торгов фьючерсами определяются другими внутренними документами Биржи и спецификациями фьючерсов, утверждаемыми Правлением Биржи.

Глава 9. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НА РЫНКЕ РЕПО

Статья 38. Торговый день по операциям репо

1. Торговый день по операциям репо, осуществляемым "прямым" и "автоматическим" способами, начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.30 алматинского времени и подразделяется на следующие торговые сессии (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года*):

- 1) основная сессия – с 11.30 до 17.00 алматинского времени;
- 2) дополнительная сессия – с 17.00 до 17.30 алматинского времени.

Сообщение о готовности исполнить сделку закрытия репо, должно быть направлено в торговую систему участником торгов либо пользователем Системы подтверждения не позднее:

- 1) 16.45 даты закрытия, если соответствующая по ней сделка открытия репо была заключена на основной сессии;
- 2) 17.30 даты закрытия, если соответствующая по ней сделка открытия репо была заключена на дополнительной сессии.

2. Торговый день по операциям репо с неттингом начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.15 алматинского времени.

Статья 39. Частные параметры проведения торгов при осуществлении операций репо "прямым" способом

Основным методом проведения торгов при осуществлении операций репо "прямым" способом является метод заключения прямых сделок; при этом:

- 1) цены открытия и закрытия репо определяются исходя из рыночной стоимости данных ценных бумаг;
- 2) срок операции репо (дата закрытия репо) определяется участниками операции репо самостоятельно по согласованию друг с другом;
- 3) понятия "цена открытия" и "лимит отклонения цены" по отношению к операции репо, осуществляемой "прямым" способом, не применяются;
- 4) дополнительные и резервные методы проведения торгов при осуществлении операций репо "прямым" способом не существуют.

Статья 40. Частные параметры проведения торгов при осуществлении операций репо "автоматическим" способом и репо с неттингом

1. Размер лота при осуществлении операций репо "автоматическим" способом составляет 1.000.000 тенге, за исключением репо с неттингом, по которым размер лота не устанавливается.
2. При проведении торгов на рынке автоматического репо и репо с неттингом цена операции репо (в качестве которой используется доходность операции репо) измеряется с точностью до четвертого знака после запятой.
3. В качестве цены открытия торговой сессии используется:
 - 1) по операциям репо, осуществляемым "автоматическим" способом, с каким-либо сроком, если в качестве предметов данных операций используются государственные ценные бумаги Республики Казахстан (за исключением ценных бумаг местных исполнительных органов) – средневзвешенная доходность всех операций репо с этим сроком исходя из сделок их открытия, заключенных на последней результативной торговой сессии;
 - 2) по операциям репо, осуществляемым "автоматическим" способом, с каким-либо сроком, если в качестве предметов данных операций используются иные, чем указанные в подпункте 1) настоящего пункта, ценные бумаги, – доходность операции репо с этим сроком исходя из первой сделки открытия, заключенной на данной торговой сессии;
 - 3) по операциям репо с неттингом – доходность операции репо с неттингом исходя из первой сделки открытия, заключенной на данной торговой сессии.
4. Лимит отклонения цены для операций репо, осуществляемых "автоматическим" способом, и для операций репо с неттингом, не установлен.
- 4-1. Торги по операциям репо с неттингом для облигаций, номинированных в долларах США, сделки по которым рассчитываются в данной валюте, не проводятся *(данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*:
 - 1) в случае, если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США в день торгов;
 - 2) за один торговый день до дня, в который по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США.
- 4-2. На дополнительной сессии осуществляются операции репо "автоматическим" способом только с Национальным Банком Республики Казахстан с учетом особенностей, предусмотренных внутренним документом Биржи "Спецификация рынка автоматического репо *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 09 октября 2019 года)*.
5. Дополнительные методы проведения торгов при осуществлении операций репо "автоматическим" способом и репо с неттингом не установлены.

Резервным методом проведения торгов при осуществлении операций репо "автоматическим" способом и репо с неттингом является метод фиксинга.

Глава 10. ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НА ПЛОЩАДКАХ KASE PRIVATE MARKET И KASE STARTUP

Параметры проведения торгов на площадках KASE Private Market и KASE Startup регламентируются отдельными внутренними документами "Положение

о порядке заключения сделок и осуществления расчетов на площадке KASE Private Market" и "Положение о порядке заключения сделок и осуществления расчетов на площадке KASE Startup" соответственно.

Глава 11. РЕГЛАМЕНТ РАБОТЫ СИСТЕМЫ КОНТРОЛЯ И ОБЕСПЕЧЕНИЯ

(данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)

Статья 41. Регламент работы системы контроля и обеспечения *(данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*

1. Система контроля и обеспечения работает ежедневно по рабочим дням РК с 11.30 до 17.45 алматинского времени *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 05 сентября 2019 года и от 09 октября 2019 года)*.
2. Время работы системы контроля и обеспечения может быть продлено Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в следующих случаях *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*:
 - 1) сбой в работе программно-технических средств Биржи, используемых при проведении торгов и приеме сообщений о подтверждении сделок, или возникновение иных непредвиденных обстоятельств, препятствующих работе системы контроля и обеспечения в обычном режиме *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*;
 - 2) поступление от участника торгов письменного заявления о продлении времени работы системы контроля и обеспечения. Указанное заявление должно содержать сведения о предполагаемом времени продления работы системы контроля и обеспечения и описание причин такого продления *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*.

Статья 42. Особенности работы системы контроля и обеспечения

(данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)

1. При проведении торгов методом специализированных торгов подлежат подтверждению те заявки иных, помимо единственного продавца (покупателя) размещаемого (продаваемого, выкупаемого, приобретаемого) финансового инструмента, участников торгов, при удовлетворении которых будут использоваться торговые счета, контролируемые участниками системы подтверждения; при этом Биржа должна получить подтверждения или отказы от подтверждения данных заявок:
 - 1) при проведении аукциона по размещению (продаже, выкупу, приобретению) финансового инструмента – в течение промежутка времени, включающего в себя период на прием Биржей данных заявок и 30 минут, следующих по окончании этого периода;
 - 2) при проведении торгов по доразмещению ценных бумаг, размещаемых на специализированных торгах, – в течение промежутка времени, включающего в себя период на прием Биржей данных заявок и 15 минут, следующих по окончании этого периода.
2. При проведении торгов по ценными бумагами по схеме T+0 подтверждение сделок осуществляется согласно внутреннему документу "Регламент осуществления расчетов по сделкам с ценными бумагами по схеме T+0 с полным обеспечением (гросс-расчеты)".

3. При проведении торгов по государственным ценным бумагам по схеме T+2 подтверждение сделок осуществляется согласно внутреннему документу "Порядок заключения сделок с государственными ценными бумагами по схеме T+2".
4. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года).*

Глава 12. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

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

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.

Приложение 1

к Регламенту торгов и работы
Системы контроля и
обеспечения *(данный
заголовок изменен решением
Правления Биржи от 05
сентября 2019 года)*

(Данное приложение изменено решением Правления Биржи от 28 февраля 2019 года)

РАЗМЕР

лота при проведении торгов долларом США

№	Минимальный размер лота, доллар США	Отклонение цены заявки от цены последней сделки, %
1.	1 000 – 99 000	0,00–0,10
2.	100 000 – 999 000	0,11–0,20
3.	1 000 000 – 2 499 000	0,21–0,40
4.	2 500 000 – 4 999 000	0,41–0,60
5.	5 000 000 – 9 999 000	0,61–0,80
6.	От 10 000 000 и выше	0,81–1,00

Приложение 2

к Регламенту торгов и работы системы контроля и обеспечения *(данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года)*

(Данное приложение изменено решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)

КРИТЕРИИ

для определения вида цен ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля долговыми ценными бумагами, допущенными к обращению на Бирже

1. Долговые ценные бумаги торгуются на Бирже в "чистых" ценах, если они соответствуют всем следующим критериям:
 - 1) номинальная стоимость облигаций является фиксированной, то есть не подлежит изменению в течение срока обращения данных облигаций *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*;
 - 2) *(данный подпункт исключен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*;
 - 3) облигации являются срочными, и срок обращения облигаций кратен каждому купонному периоду;
 - 4) облигации имеют фиксированную дату погашения;
 - 5) облигации имеют фиксированные даты купонных выплат, одинаковые в каждом году обращения;
 - 6) расчетный базис облигаций – 30 / 360 или actual / actual;
 - 7) размер купонного вознаграждения по облигациям фиксированный либо плавающий (индексированный), но при этом размер купонного вознаграждения на очередной купонный период должен быть известен Бирже не менее чем за два рабочих дня РК до начала очередного купонного периода;
 - 8) облигации не являются амортизированными, условиями выпуска облигаций не предусмотрен график их частичного досрочного погашения. Возможным допущением при этом может быть частичное досрочное погашение облигаций путем сокращения количества облигаций, находящихся в обращении, что четко должно быть изложено в проспекте выпуска облигаций (или сходном по значению документе);
 - 9) не предусмотрена в каком-либо виде капитализация купонного вознаграждения, начисляемого на облигации;
 - 10) не предусмотрены начисление и выплата любых иных сумм по облигациям, за исключением купонного вознаграждения и номинала долга по истечении срока обращения.
2. Долговые ценные бумаги торгуются на Бирже в "грязных" ценах в валюте котирования, если они соответствуют всем следующим критериям *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 26 июня 2019 года и от 09 октября 2019 года)*:
 - 1) долговые ценные бумаги не являются дисконтными;
 - 2) номинальная стоимость облигаций является индексированной;
 - 3) долговые ценные бумаги не соответствуют хотя бы одному из критериев, указанных в пункте 1 настоящего Приложения.

- 2-1. Если номинальная стоимость облигаций индексированная, то она индексируется в одинаковом порядке как для начисления купонного вознаграждения, так и для выплаты основного долга при погашении *(данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года)*.
3. При внесении в проспект выпуска облигаций какого-либо наименования (или сходный по значению документ) изменений и/или дополнений, в соответствии с которыми облигации данного наименования перестают соответствовать хотя бы одному из критериев, указанных в пункте 1 настоящего Приложения, или, наоборот, становятся соответствующими всем критериям, приведенным в пункте 1 настоящего Приложения, Правление Биржи принимает решение об изменении режима торговли облигациями данного наименования – переводе с торговли в "чистых" ценах на торговлю в "грязных" ценах либо наоборот. Основанием для такого решения Правления служит информация Департамента мониторинга о предоставлении на Биржу инициатором допуска облигаций данного наименования изменений и/или дополнений в проспект выпуска облигаций данного наименования (или сходный по значению документ).