

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 27 января 2012 года № 17)

Введен в действие

с 01 февраля 2012 года

РЕГЛАМЕНТ торгов и работы Системы подтверждения

г. Алматы

2012

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 11 мая 2012 года № 83);
- введены в действие с 02 июля 2012 года, за исключением пункта 6 статьи 13, который будет введен в действие после внесения соответствующих изменений в торговую систему.

2. Изменения и дополнения № 2:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 23 мая 2014 года № 75);
- введены в действие с 01 июля 2014 года.

3. Изменение № 3:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 18 июня 2014 года № 89);
- введено в действие с 19 июня 2014 года.

4. Изменение № 4:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 21 января 2015 года № 8);
- введено в действие с 22 января 2015 года.

5. Дополнение и изменение № 5:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 30 марта 2015 года № 39);
- введены в действие с 31 марта 2015 года.

6. Изменения и дополнения № 6:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 августа 2015 года № 97);
- введены в действие с 01 сентября 2015 года.

7. Изменение № 7:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 21 сентября 2015 года № 107);
- введено в действие с 21 сентября 2015 года.

8. Изменения № 8:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 ноября 2015 года № 125);
- введены в действие с 10 ноября 2015 года.

9. Изменения и дополнение № 9:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 08 декабря 2015 года № 137);
- введены в действие с 15 декабря 2015 года.

10. Изменения № 10:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 29 февраля 2016 года № 26);
- введены в действие с 01 марта 2016 года.

11. Изменение № 11:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 14 апреля 2016 года № 42);
- введено в действие с 11 мая 2016 года.

12. Изменение № 12:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 24 июня 2016 года № 62);
- введено в действие с 07 июля 2016 года.

13. Изменения и дополнение № 13:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 02 февраля 2017 года № 8);
- введены в действие с 06 февраля 2017 года.

14. Изменения № 14:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 13 февраля 2017 года № 11);
- введены в действие с 20 февраля 2017 года.

15. Дополнение и изменение № 15:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 апреля 2017 года № 42);
- введены в действие с 02 мая 2017 года.

16. Изменение № 16:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 08 сентября 2017 года № 89);
- введено в действие с 11 сентября 2017 года.

17. Дополнение № 17:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 15 декабря 2017 года № 129);
- введено в действие с 25 декабря 2017 года.

18. Изменения и дополнения № 18:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 23 февраля 2018 года № 20);
- введены в действие с 05 марта 2018 года.

19. Изменения и дополнения № 19:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 14 августа 2018 года № 84);
- введены в действие с 10 сентября 2018 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 подтверждения.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Понятия

1. Используемые в настоящем Регламенте понятия означают следующее:
 - 1) **"лимит отклонения цены"** – 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 Биржевого совета или Правления Биржи, настройками торговой системы;
 - 2) **"лот"** – единица торговли финансовым инструментом; количество финансового инструмента, которому должен быть равен или кратен размер заявки по данному финансовому инструменту;
 - 3) **"маклер Биржи"** – руководитель структурного подразделения Биржи, осуществляющего функции по организации и проведению торгов;
 - 4) **"результативная торговая сессия"** – торговая сессия по какому-либо финансовому инструменту, в ходе которой была заключена хотя бы одна сделка с данным финансовым инструментом;
 - 5) **"торговая система"** – программно-технический комплекс Биржи, посредством которого заключаются сделки с финансовыми инструментами;
 - 6) **"цена открытия торговой сессии"** – одна из характеристик торговой сессии, используемая в иллюстративных целях, для принятия каких-либо решений или совершения каких-либо действий, либо в иных целях;
 - 7) **"чистая" цена** – выраженная в процентах от номинальной стоимости (от номинала долга) с точностью до четвертого знака после запятой цена долговой ценной бумаги без учета накопленного (начисленного, но не выплаченного) купонного вознаграждения;
 - 8) **"грязная" цена** – цена долговой ценной бумаги с учетом накопленного (начисленного, но не выплаченного) купонного вознаграждения. "Грязная" цена выражается в процентах от номинальной стоимости (от номинала долга), за исключением случаев, когда решением Правления Биржи в отношении какой-либо ценной бумаги установлено, что ее "грязная" цена выражается в тенге либо другой валюте сообразно валюте деноминации и/или обслуживания данной ценной бумаги. Такое решение Правлением Биржи принимается, если свойства и условия выпуска данной ценной бумаги не позволяют корректно вычислять ее цену в процентах от номинальной стоимости (от номинала долга) *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*;
 - 9) **"операционный день"** – часть рабочего дня, в течение которой Биржей осуществляются процедуры по организации и администрированию торгов, клирингу и расчетам по сделкам с финансовыми инструментами *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*.

2. Прочие понятия, используемые в настоящем Регламенте, идентичны понятиям, определенным другими внутренними документами Биржи.
3. Для целей настоящего Регламента:
 - 1) под финансовыми инструментами понимаются только те из них, которые допущены к обращению на Бирже;
 - 2) под торгами понимаются торги, проводимые Биржей;
 - 3) под сделками понимаются сделки с финансовыми инструментами, заключенные на торгах;
 - 4) под заявками понимаются заявки на заключение сделок;
 - 5) под акциями первого (либо второго или третьего) класса ликвидности понимаются акции, которые включены в действующий в список¹ ценных бумаг первого (либо второго или третьего) класса ликвидности *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*;
 - 6) под рабочим днем понимается исключительно день, который является рабочим в Республике Казахстан *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*.

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 6 настоящего Регламента *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 августа 2015 года)*.
5. Размеры лотов (с учетом особенности, установленной абзацем вторым настоящего пункта), единицы измерения цен финансовых инструментов, цены открытия торговых сессий, дополнительные и резервные методы проведения торгов определяются главами 2–8 настоящего Регламента.

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

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:
 - 1) с рабочего места в зале торгов Биржи;
 - 2) в режиме удаленного доступа (в том числе с использованием программно-криптографических средств защиты информации).
2. В случае невозможности проведения торгов в торговой системе они проводятся голосовым способом в зале торгов Биржи либо в ином месте, определенном в этих целях Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 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.

Статья 4. Время проведения торгов

1. Торги проводятся каждый рабочий день в течение торгового дня, отдельно устанавливаемого главами 2–8 настоящего Регламента для каждой группы финансовых инструментов (за исключением, установленным абзацем вторым настоящего пункта) *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*.

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 9 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 Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в следующих случаях *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года)*:
 - 1) сбой в работе программно-технических средств, используемых при проведении торгов, или возникновение иных непредвиденных обстоятельств, препятствующих проведению торгов в обычном режиме;

² *(Данная сноска исключена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*.

- 2) изменение места проведения торгов в соответствии с пунктом 2 статьи 3 настоящего Регламента;
- 3) 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;
- 4) 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, заявление о продлении операционного дня Биржи на тот же срок, на который предполагается продление торгов (с учетом особенности, установленной пунктом 5 настоящей статьи) *(данный подпункт дополнен решением Правления Биржи от 30 марта 2015 года)*.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

4. Члены Биржи – участники торгов извещаются об изменении времени их проведения через торговую систему и иными возможными способами.
5. В случае если продление торгового дня по отдельным финансовым инструментам в целях закрытия каким-либо участником торгов ранее открытых позиций и/или исполнения обязательств по ранее заключенным сделкам с этими финансовыми инструментами предполагается до 18.00 алматинского времени, то заявление о продлении операционного дня, указанное в подпункте 4) пункта 3 настоящей статьи, от данного участника торгов не требуется *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года и изменен решениями Правления Биржи от 30 марта 2015 года и от 02 февраля 2017 года)*.

Статья 4-1. 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 19.00 алматинского времени с учетом особенностей, установленных пунктом 3 и подпунктом 2) пункта 4 настоящей статьи.
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 19.00 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.

(Данная статья включена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года и изменена решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 02 февраля 2017 года).

Статья 5. 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 подтверждения.

Статья 6. 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.
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 в 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 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 вторым 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.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

3. Торги ценными бумагами (акциями, облигациями), проводимые методом непрерывного встречного аукциона, переводятся в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов:
 - 1) в случае если при совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку акций, допущенных к обращению на Бирже, цена предполагаемой сделки отличается от цены последней сделки с данными акциями на 5 % *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года);*
 - 2) в случае совпадения или пересечения цен, указанных во встречных заявках на продажу и покупку акций, допущенных к обращению на Бирже, при отсутствии сделок с данными акциями в течение 5 календарных дней и более;
 - 3) в случае совпадения или пересечения цен, указанных во встречных заявках на продажу и покупку облигаций и паев, допущенных к обращению на Бирже *(данный подпункт дополнен решением Правления Биржи от 28 августа 2015 года);*
 - 4) в случае совпадения или пересечения цен, указанных в предварительных встречных заявках на продажу и покупку.
4. При переводе торгов, проводимых в торговой системе методом непрерывного встречного аукциона, в режим ожидания:
 - 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. При проведении торгов методом непрерывного встречного аукциона для отдельных групп финансовых инструментов настоящим Регламентом или настройками торговой системы может быть установлена возможность перевода торгов в конце рабочего дня в режим их проведения методом франкфуртских торгов с целью формирования репрезентативного значения цены закрытия торгового дня (далее – аукцион закрытия).
6. В случае проведения аукциона закрытия:
- 1) такой аукцион открывается ежедневно (каждый рабочий день) за 15 минут до окончания торгового дня;
 - 2) аукцион закрытия длится более 13 минут и не более 15 минут;
 - 3) аукцион закрытия завершается в случайный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, с 14-й по 15-ую минуту его проведения;
 - 4) окончание торгового дня осуществляется одновременно с окончанием аукциона закрытия;
 - 5) заявки, поданные до начала аукциона закрытия и в ходе его проведения, могут быть аннулированы, равно как и могут быть изменены их условия.

Статья 7. 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 решений Биржевого совета 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 право отказать в удовлетворении такой просьбы, но обязан предварительно известить других участников торгов о снятии или увеличении указанного лимита.

4. Жесткие (непреодолимые) лимиты отклонения цен устанавливаются в торговой системе на основании решений Биржевого совета 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 право снять или увеличить указанный 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 8. 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 подтверждения 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.

(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года).

Глава 2. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ИНОСТРАННЫМИ ВАЛЮТАМИ

Статья 9. Торговый день

1. Торговый день по иностранным валютам начинается в 10.15 алматинского времени, заканчивается в 17.00 алматинского времени и подразделяется на три торговые сессии:

- 1) утренняя сессия – с 10.15 до 11.00 алматинского времени;

- 2) дневная сессия – с 11.30 до 15.30 алматинского времени;
 - 3) вечерняя сессия – с 11.30 до 17.00 алматинского времени.
2. Статьями 10–12-1 настоящего Регламента для каждой иностранной валюты устанавливается, на каких именно торговых сессиях торгуется данная иностранная валюта *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года)*.
- (Данный абзац исключен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 года)*.

Статья 10. 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).

При проведении торгов USDKZT_TOM в несколько торговых сессий настоящим Регламентом также определяется, какая из этих торговых сессий является основной, а какая (какие) – дополнительной (дополнительными) *(данный абзац включен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 года)*.

2. USDKZT_TOD торгуется на утренней и дневной торговых сессиях (с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи).

USDKZT_TOM торгуется на утренней и дневной торговых сессиях, из которых основной является утренняя, а дневная – дополнительной (с учетом особенности, установленной пунктом 4 настоящей статьи).

(Данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года, от 29 февраля 2016 года и от 14 августа 2018 года).

3. Торги USDKZT_TOD не проводятся в случае, если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США в день торгов (по причине праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам), но будут осуществлять их на следующий рабочий день после дня торгов *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 29 февраля 2016 года)*.
4. В случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США на следующий рабочий день после дня торгов (по причине праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам), но будут осуществлять их на второй рабочий день после дня торгов *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 года)*:

 - 1) USDKZT_TOM не проводятся *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 года)*;
 - 2) торги USDKZT_SPT проводятся на утренней и дневной торговых сессиях, из которых основной является утренняя, а дневная – дополнительной *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года)*.

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).

⁴ См. Инструкцию о порядке кодировки членов АО "Казахстанская фондовая биржа", финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг, утвержденную решением Правления Биржи от 10 февраля 2004 года № 19/0.

- 4-1. Торги USDKZT_SPT не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничные дни, наступление обстоятельств непреодолимой силы или иные возможные причины) банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США на второй рабочий день после дня торгов *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 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 *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)*.
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 *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 29 февраля 2016 года)*.
8. При проведении торгов долларом США установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 1 % от цены последней сделки *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 21 января 2015 года, от 28 августа 2015 года, от 21 сентября 2015 года и от 08 декабря 2015 года)*.
9. Дополнительные методы проведения торгов долларом США не установлены.
Резервным методом проведения торгов долларом США (вне зависимости от сроков расчетов) является метод фиксинга.
10. В случае если длительность перерыва между днем торгов долларом США и днем осуществления расчетов (в рабочих днях) по заключенным на этих торгах сделкам составляет три и более рабочих дней, то особенности регламента проведения данных торгов определяются Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, и доводятся до сведения членов Биржи – участников торгов долларом США через торговую систему и иными возможными способами *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года)*.

Статья 11. 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.
2. EURKZT_TOD и EURUSD_TOD торгуются на утренней и дневной торговых сессиях (с учетом особенностей, установленных пунктом 4 настоящей статьи) *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 14 августа 2018 года)*.
EURKZT_TOM, EURUSD_TOM, EURKZT_SPT и EURUSD_SPT торгуются на дневной торговой сессии (с учетом особенностей, установленных пунктом 4 настоящей статьи) *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года)*.

3. В случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по евро не осуществляют расчеты в евро в какой-либо рабочий день (по причине праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам), Биржа не проводит торги по евро (вне зависимости от валюты расчетов) со сроком осуществления расчетов, приходящимся на этот день.

В случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США в какой-либо рабочий день, Биржа не проводит торги по евро с расчетами в долларах США и сроком осуществления расчетов, приходящимся на этот день.
4. Если в соответствии с пунктом 3 настоящей статьи Биржа не проводит торги:
 - 1) по EURKZT_TOD, но при этом проводит торги по EURKZT_TOM, то торги по EURKZT_TOM проводятся на утренней и дневной торговых сессиях *(данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 14 августа 2018 года)*;
 - 2) по EURUSD_TOD, но при этом проводит торги по EURUSD_TOM, то торги по EURUSD_TOM проводятся на утренней и дневной торговых сессиях *(данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 14 августа 2018 года)*;
 - 3) по EURKZT_TOD и EURKZT_TOM, но при этом проводит торги по EURKZT_SPT, то торги по EURKZT_SPT проводятся на утренней и дневной торговых сессиях *(данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 14 августа 2018 года)*;
 - 4) по EURUSD_TOD и EURUSD_TOM, но при этом проводит торги по EURUSD_SPT, то торги по EURUSD_SPT проводятся на утренней и дневной торговых сессиях *(данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 10 ноября 2015 года и от 14 августа 2018 года)*.
5. Размер лота при проведении торгов евро составляет:
 - 1) при проведении торгов EURKZT_TOD и EURUSD_TOD – 50.000 евро;
 - 2) при проведении торгов EURKZT_TOM, EURKZT_SPT, EURUSD_TOM и EURUSD_SPT – 100.000 евро.
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.
10. В случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по евро и/или долларам США не осуществляют расчеты соответственно в евро и/или долларах США в течение трех рабочих дней подряд (по

причине праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам), то особенности регламента проведения торгов евро определяются Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, и доводятся до сведения членов Биржи – участников торгов евро через торговую систему и иными возможными способами (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 года*).

Статья 12. 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") с учетом следующих условий:
 - 1) RUBKZT_TOD торгуется на утренней и дневной торговых сессиях.
Торги RUBKZT_TOD не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничные дни, наступление обстоятельств непреодолимой силы или иные возможные причины) банки – корреспонденты Биржи по рублю не осуществляют расчеты в рублях в день торгов;
 - 2) RUBKZT_TOM торгуется на дневной торговой сессии.
Торги RUBKZT_TOM не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничные дни, наступление обстоятельств непреодолимой силы или иные возможные причины) банки – корреспонденты Биржи по рублю не осуществляют расчеты в рублях на следующий рабочий день после дня торгов;
 - 3) RUBKZT_SPT торгуется на дневной торговой сессии.
Торги RUBKZT_SPT не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничные дни, наступление обстоятельств непреодолимой силы или иные возможные причины) банки – корреспонденты Биржи по рублю не осуществляют расчеты в рублях на второй рабочий день после дня торгов.
- (Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года).*
2. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года).*
 3. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года).*
 4. Размер лота при проведении торгов российским рублем составляет 100.000 российских рублей.
 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.

(Данная статья изменена решениями Правления Биржи от 23 мая 2014 года и от 13 февраля 2017 года).

Статья 12-1. 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") с учетом следующих условий:

- 1) CNYKZT_TOD торгуется на утренней торговой сессии.

Торги CNYKZT_TOD не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам) банки – корреспонденты Биржи по юаню не осуществляют расчеты в юанях в день торгов;

- 2) CNYKZT_TOM торгуется на дневной торговой сессии.

Торги CNYKZT_TOM не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам) банки – корреспонденты Биржи по юаню не осуществляют расчеты в юанях на следующий рабочий день после дня торгов;

- 3) CNYKZT_SPT торгуется на дневной торговой сессии.

Торги CNYKZT_SPT не проводятся в случае, если по каким-либо причинам (праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам) банки – корреспонденты Биржи по юаню не осуществляют расчеты в юанях на второй рабочий день после дня торгов.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи и от 08 сентября 2017 года).

2. Размер лота при проведении торгов юанем составляет 50 000 юаней.
3. При проведении торгов юанем его цена измеряется в казахстанских тенге за один юань с точностью до четвертого знака после запятой.
4. В качестве цены открытия торговой сессии по юаню используется цена первой сделки, заключенной на данной торговой сессии.
5. Для юаня установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 3 % от цены последней сделки.
6. Дополнительные методы проведения торгов юанем не установлены.

Резервным методом проведения торгов юанем является метод фиксинга.

(Данная статья включена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года и изменена решением Правления Биржи от 13 февраля 2017 года).

Статья 13. 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 следующих видов сделок с долларом США как входящих в эти операции:

- 1) сделок с USDKZT_TOD или USDKZT_TOM как сделок с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года)*;

- 2) сделок с USDKZT_TOM или USDKZT_SPT как сделок с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).
2. Операции валютного свопа осуществляются в отношении евро как предмета этих операций и следующих видов сделок с евро как входящих в эти операции:
 - 1) сделок с EURKZT_TOD или EURKZT_TOM как сделок с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3 настоящей статьи) *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года)*;
 - 2) сделок с EURKZT_TOM или EURKZT_SPT как сделок 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.
- 3-1. Операции валютного свопа осуществляются в отношении рубля как предмета этих операций и следующих видов сделок с рублем как входящих в эти операции:
 - 1) сделок с RUBKZT_TOD или RUBKZT_TOM как сделок с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3-2 настоящей статьи);
 - 2) сделок с RUBKZT_TOM или RUBKZT_SPT как сделок с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).

(Данный пункт включен решением Правления Биржи и от 23 февраля 2018 года).
- 3-2. 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 *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года)*.
- 3-3. Операции валютного свопа осуществляются в отношении юаня как предмета этих операций и следующих видов сделок с юанем как входящих в эти операции:
 - 1) сделок с CNYKZT_TOD или CNYKZT_TOM как сделок с более ранним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми начинаются (открываются) операции валютного свопа) (с учетом особенности, установленной пунктом 3-4 настоящей статьи);
 - 2) сделок с CNYKZT_TOM или CNYKZT_SPT как сделок с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).

(Данный пункт включен решением Правления Биржи и от 23 февраля 2018 года).
- 3-4. Сделки с CNYKZT_TOM могут использоваться для начала (открытия) операций валютного свопа только в случае, если в день такого начала (открытия) торги соответственно по CNYKZT_TOD не проводятся *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 23 февраля 2018 года)*.
4. Операции валютного свопа в отношении юаня начинаются (открываются) на утренней торговой сессии.

Операции валютного свопа в отношении доллара США, евро и рубля начинаются (открываются) на дневной торговой сессии.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи и от 23 февраля 2018 года).

5. Размер лота при осуществлении операций валютного свопа составляет 100.000 единиц валюты, являющейся предметом операции валютного свопа.
6. 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 *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 11 мая 2012 года и от 14 апреля 2016 года).*
7. 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.
8. 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 14. Торговый день

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

Статья 15. 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 16. Лимиты отклонения цен

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 17. 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 *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года)*.

2. Торги еврооблигациями какого-либо наименования проводятся:
в "чистых" ценах, если еврооблигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)*;
либо
в "грязных" ценах, если еврооблигации данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)*.
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 18. Частные параметры торгов ценными бумагами Правительства, Национального Банка Республики Казахстан⁵ 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 *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года)*.
2. Торги государственными облигациями какого-либо наименования проводятся:
в "чистых" ценах, если государственные облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)*;
либо
в "грязных" ценах, если государственные облигации данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)*.
3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо государственным облигациям используется цена первой сделки с этими государственным 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.

⁵ Кроме международных ценных бумаг Республики Казахстан, частные параметры проведения торгов которыми установлен статьей 17 настоящего Регламента.

Глава 4. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НЕГОСУДАРСТВЕННЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 19. Торговый день

Торговый день по негосударственным ценным бумагам начинается в 11.30 алматинского времени (за исключением акций второго и третьего классов ликвидности, торговый день по которым начинается в 15.00 алматинского времени) и заканчивается в 17.00 алматинского времени (с учетом особенности, установленной пунктом 4 статьи 21 настоящего Регламента).

Статья 20. Лимиты отклонения цен

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 21. Частные параметры проведения торгов акциями

1. Размер лота при проведении торгов акциями не устанавливается.
2. Если иное не установлено решением Правления Биржи в отношении акций какого-либо отдельного наименования, при проведении торгов акциями их цена измеряется в казахстанских тенге за одну акцию с точностью до второго знака после запятой (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 24 июня 2016 года*).
3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо акциям используется цена первой сделки с этими акциями, заключенной на данной торговой сессии.
4. За 15 минут до завершения торгов акциями проводится аукцион закрытия.
5. Дополнительным методом проведения торгов акциями является метод заключения прямых сделок.
Резервным методом проведения торгов акциями является метод фиксинга.

Статья 22. 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 (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года*).
2. Торги листинговыми облигациями какого-либо наименования проводятся: в "чистых" ценах, если листинговые облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые

установлены приложением 2 к настоящему Регламенту ([данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года](#));

либо

в "грязных" ценах, если листинговые облигации данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту ([данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года](#)).

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

Резервным методом проведения торгов листинговыми облигациями является метод фиксинга.

Статья 23. 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 ([данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года](#)).

2. Торги нелистинговыми облигациями какого-либо наименования проводятся:

в "чистых" ценах, если нелистинговые облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту ([данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года](#));

либо

в "грязных" ценах, если нелистинговые облигации данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту ([данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года](#)).

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 24. 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 4-1. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

(Данная глава включена решением Правления Биржи от 28 августа 2015 года).

Статья 24-1. Торговый день

Торговый день по ценным бумагам инвестиционных фондов начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени.

Статья 24-2. Частные параметры проведения торгов акциями акционерных инвестиционных фондов

Торги акциями акционерных инвестиционных фондов проводятся в порядке, установленном статьей 21 настоящего Регламента.

Статья 24-3. Частные параметры проведения торгов паями

1. Размер лота при проведении торгов паями составляет целый пай либо долю пая. Минимальный размер лота составляет не менее одной миллионной доли пая⁶.

Размер лота и минимальное количество лотов в заявке устанавливаются инициатором допуска таких паев.

2. При проведении торгов паями их цена измеряется в казахстанских тенге за один пай с точностью до второго знака после запятой.
3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо паям используется цена первой сделки с этими паями, заключенной на данной торговой сессии.
4. Дополнительным методом проведения торгов паями является метод заключения прямых сделок.

При использовании метода заключения прямых сделок участники торгов обязаны соблюдать размер лота, установленный пунктом 1 настоящей статьи.

⁶ Например, при установлении размера лота в одну миллионную долю пая заявки подаются следующим образом: при покупке и/или продаже одного пая участнику торгов в количестве заявки необходимо указать 1.000.000 лотов; при подаче заявки на покупку и/или продажу 1,375 пая в количестве заявки необходимо указать 1.375.000 лотов *(данная сноска включена решением Правления Биржи от 28 августа 2015 года).*

Резервным методом проведения торгов паями является метод фиксинга.

Глава 5. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ И ИНОСТРАННЫМИ ГОСУДАРСТВЕННЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 25. 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 26. 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 27. 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 (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года*).
2. Торги облигациями МФО какого-либо наименования проводятся:
в "чистых" ценах, если облигации МФО данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту (*данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года*);
либо
в "грязных" ценах, если облигации МФО данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту (*данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года*).
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 28. 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 (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 11 мая 2012 года*).
2. Торги иностранными государственными облигациями какого-либо наименования проводятся:

в "чистых" ценах, если иностранные государственные облигации данного наименования являются дисконтными или соответствуют всем критериям, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту (*данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года*);

либо

в "грязных" ценах, если иностранные государственные облигации данного наименования не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, которые установлены приложением 2 к настоящему Регламенту (*данный абзац изменен решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года*).

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 5-1. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ
ПРОИЗВОДНЫМИ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ**

(Данная глава включена решением Правления Биржи от 15 декабря 2017 года).

Статья 28-1. Торговый день

Торговый день по производным ценным бумагам начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени.

Статья 28-2. Частные параметры проведения торгов производными ценными бумагами

1. Размер лота при проведении торгов производными ценными бумагами не устанавливается.
2. При проведении торгов производными ценными бумагами их цена измеряется в единицах валюты их размещения за одну производную ценную бумагу с точностью до второго знака после запятой.
3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо производным

ценным бумагам используется цена первой сделки с этими производными ценными бумагами, заключенной на данной торговой сессии.

4. Дополнительным методом проведения торгов производными ценными бумагами является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов производными ценными бумагами является метод фиксинга.

Глава 6. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ФЬЮЧЕРСАМИ

(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

Статья 29. Торговый день

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

(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

Статья 30. *(Данная статья исключена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).*

Статья 31. Частные параметры проведения торгов фьючерсами

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

(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

Глава 7. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НА РЫНКЕ РЕПО

Статья 32. 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 17.00 алматинского времени.

Сообщение о готовности исполнить сделку закрытия репо должно быть направлено в торговую систему участником торгов либо пользователем Системы подтверждения не позднее 16:45 даты закрытия.

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

(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 02 февраля 2017 года).

Статья 33. 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; соответственно:

- 1) цены открытия и закрытия репо, а также срок операции репо (дата закрытия репо) определяются участниками операции репо самостоятельно по согласованию друг с другом;
- 2) понятия "цена открытия" и "лимит отклонения цены" по отношению к операции репо, осуществляемой "прямым" способом, не применяются;

- 3) дополнительные и резервные методы проведения торгов при осуществлении операций репо "прямым" способом не существуют.

Статья 34. 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 тенге⁴, 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.
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.

(Данная статья изменена решением Правления Биржи от 02 февраля 2017 года).

Глава 8. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ВЕКСЕЛЯМИ

Статья 35. Торговый день

Торговый день по вексялям начинается в 11.30 алматинского времени и заканчивается в 17.00 алматинского времени.

Статья 36. Частные параметры проведения торгов вексялями

1. Размер лота при проведении торгов вексялями не устанавливается.
2. При проведении торгов вексялями их цена измеряется в казахстанских тенге за один вексель с точностью до второго знака после запятой.

3. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо векселям используется цена первой сделки с этими векселями, заключенной на данной торговой сессии.
4. Лимит отклонения цены для векселей не установлен.
4. Основным методом проведения торгов векселями является метод заключения прямых сделок.
5. Дополнительным методом проведения торгов векселями является метод непрерывного встречного аукциона.
Резервным методом проведения торгов векселями является метод фиксинга.

Глава 9. РЕГЛАМЕНТ РАБОТЫ СИСТЕМЫ ПОДТВЕРЖДЕНИЯ

Статья 37. Регламент работы Системы подтверждения

1. Система подтверждения работает ежедневно по рабочим дням с 11.30 до 17.30 алматинского времени.
2. Время работы Системы подтверждения может быть продлено Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в следующих случаях *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 10 ноября 2015 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 подтверждения в обычном режиме;
 - 2) поступление от участника торгов письменного заявления о продлении времени работы Системы подтверждения (с учетом особенностей, установленных пунктом 5 настоящей статьи). Указанное заявление должно содержать сведения о предполагаемом времени продления работы Системы подтверждения, описание причин такого продления, заявление о продлении операционного дня Биржи на тот же срок, на который предполагается продление времени работы Системы подтверждения.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 23 мая 2014 года).

Статья 38. Особенности работы Системы подтверждения

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.

Президент

Дамитов К.К.

Приложение 1

к Регламенту торгов и работы
Системы подтверждения

РАЗМЕР

лота при проведении торгов долларом США

(Данное приложение включено решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года).

№	Минимальный размер лота, доллар США	Отклонение цены заявки от цены последней сделки, %
1.	50 000	0,00–0,10
2.	100 000	0,11–0,20
3.	1 000 000	0,21–0,40
4.	2 500 000	0,41–0,60
5.	5 000 000	0,61–0,80
6.	10 000 000	0,81–1,00

Приложение 2

(нумерация данного приложения изменена решением Правления Биржи от 08 декабря 2015 года)

к Регламенту торгов и работы Системы подтверждения

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, либо является индексированной, при этом в качестве коэффициента индексации используется коэффициент девальвации/ревальвации, который рассчитывается как отношение официального (рыночного) курса Национального Банка Республики Казахстан какой-либо иностранной валюты, установленного на день заключения сделки с данными облигациями, к официальному (рыночному) курсу Национального Банка Республики Казахстан данной иностранной валюты, установленного на дату начала обращения данных облигаций, или отношение биржевого курса тенге к какой-либо иностранной валюте, установленного по результатам утренней сессии в день заключения сделки с облигациями, к биржевому курсу тенге к данной иностранной валюте на дату начала обращения облигаций (*данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 18 июня 2014 года и от 28 апреля 2017 года*);
 - 2) если номинальная стоимость облигаций индексированная, то она индексируется в одинаковом порядке как для начисления купонного вознаграждения, так и для выплаты основного долга при погашении;
 - 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 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, если не являются дисконтными и не соответствуют хотя бы одному из критериев, указанных в пункте 1 настоящего Приложения.
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 Отдела 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) *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 апреля 2017 года)*.