

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 04 июня 2020 года № 74)

Введен в действие

с 03 августа 2020 года

РЕГЛАМЕНТ

торгов и работы системы контроля и обеспечения

г. Алматы,

2020

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменение № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 14 июля 2020 года № 96);
- введены в действие с 03 августа 2020 года.

Настоящий Регламент определяет основные параметры порядка проведения торгов в торговых системах АСТ и NEXТ и торгово-клиринговой системе АСТS+ финансовыми инструментами, допущенными к обращению на проводимых АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) торгах (к обращению на Бирже), и работы системы контроля и обеспечения.

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 или Правления Биржи, настройками торговой системы;
 - 2) под нерабочим днем понимается рабочий день Республики Казахстан, в который по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи не осуществляют расчеты по соответствующим иностранным валютам и тенге;
 - 3) под рабочим днем Республики Казахстан понимается исключительно день, который является рабочим в Республике Казахстан;
 - 4) под твердой котировкой понимается котировка, накладывающая на объявившего ее участника торгов обязательство заключить сделку на основании данной котировки;
 - 5) под финансовыми инструментами понимаются только те из них, которые допущены к обращению на Бирже.
2. Иные понятия и термины, используемые в настоящем Регламенте, определяются в соответствии с законодательством Республики Казахстан и внутренним документом Биржи "Правила осуществления биржевой деятельности".

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 статьями 4 и 16 настоящего Регламента, а также приложениями 1 и 3 к настоящему Регламенту.
4. Основной метод проведения торгов определяется статьей 6 настоящего Регламента.
5. Размеры лотов, единицы измерения цены финансовых инструментов, цена открытия торговых сессий, дополнительные и резервные методы проведения торгов определяются главами 2–6 настоящего Регламента.

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).
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.
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 Республики Казахстан в течение торгового дня, отдельно устанавливаемого 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, биржевых и клиринговых сборах"), может отличаться от торгового дня, установленного для группы финансовых инструментов, к которой относится данный предмет торгов.
2. Торговый день по иностранным валютам на отдельные торговые сессии не подразделяется; торги такими иностранными валютами проводятся в одну торговую сессию, совпадающую по своей продолжительности с торговым днем, за исключением операций валютного свопа в отношении доллара США, торговый день по которым подразделяется на основную и дополнительную сессии.
3. Торговый день по ценным бумагам подразделяется на отдельные торговые периоды:
 - 1) аукцион открытия;
 - 2) непрерывный встречный аукцион (с учетом особенности, установленной пунктом 9 статьи 6 настоящего Регламента);
 - 3) аукцион закрытия.
4. 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 на рынке иностранных валют или на рынке деривативов 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.
5. Члены Биржи – участники торгов извещаются об изменении времени их проведения через торговую систему и иными возможными способами.

Статья 5. Ограничение времени заключения повторных сделок

В случае если внутренними документами Биржи разрешено заключение повторных (в том числе и дублирующих повторных) сделок в режимах торгов без ЦК 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.

Статья 6. Основной метод проведения торгов

1. Если иное не установлено главами 2–6 настоящего Регламента и другими внутренними документами Биржи для отдельных групп финансовых инструментов, основным методом проведения торгов является метод непрерывного встречного аукциона.
2. Торги финансовым инструментом USDKZT_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 при:
 - 1) совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку цена предполагаемой первой сделки текущего торгового дня отличается от цены последней сделки предыдущего торгового дня по данному инструменту на 1,5 % и более либо
совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку цена предполагаемой сделки отличается от цены первой сделки текущего 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.

3. При переводе торгов по инструменту USDKZT_TOM, проводимых в торговой системе методом непрерывного встречного аукциона, в режим ожидания:
 - 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.
4. Аукцион открытия проводится по ценным бумагам, торгующимся в режимах торгов, в которых сделки купли-продажи заключаются методом непрерывного встречного аукциона.
5. Аукцион открытия начинается в 11.20 алматинского времени.
6. В период проведения аукциона открытия:
 - 1) продолжительность периода приема Биржей заявок составляет 9 минут 30 секунд;
 - 2) завершение периода приема заявок определяется в случайный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, не превышающий 30 секунд с момента завершения периода приема заявок;
 - 3) по окончании случайного завершения периода приема заявок, установленного подпунктом 2) настоящего пункта, осуществляется определение цены аукциона открытия и заключение сделок по такой цене.
7. Сделки, заключенные в ходе аукциона открытия, учитываются при формировании результатов торгов по каждому финансовому инструменту.
8. Заявки, неудовлетворенные в ходе аукциона открытия, сохраняются в торговой системе как действующие.
9. Торги ценными бумагами (акциями, облигациями, паями), проводимые методом непрерывного встречного аукциона, в течение торгового дня могут проводиться методом дискретного аукциона. При этом первый дискретный аукцион проводится:
 - 1) в случае изменения цены последней сделки с акциями, допущенными к обращению на Бирже, относительно цены предыдущей сделки с данными акциями на 5 % и более;
 - 2) в случае изменения цены последней сделки с облигациями и паями, допущенными к обращению на Бирже, относительно средневзвешенной цены предыдущего торгового дня с данными облигациями и паями на 1 % и более.
10. Повторный дискретный аукцион проводится:
 - 1) в случае изменения цены последней сделки с акциями, допущенными к обращению на Бирже, относительно цены отсечения предыдущего дискретного аукциона текущего торгового дня с данными акциями на 5 % и более; в случае отсутствия цены отсечения предыдущего

- дискретного аукциона – от цены предыдущей сделки с акциями данного наименования;
- 2) в случае изменения цены заключившейся сделки с облигациями и паями, допущенными к обращению на Бирже, относительно цены отсечения предыдущего дискретного аукциона текущего торгового дня с данными облигациями и паями на 1 % и более; в случае отсутствия цены отсечения предыдущего дискретного аукциона – от средневзвешенной цены предыдущего торгового дня с облигациями и паями данного наименования.
11. Дискретный аукцион по какой-либо ценной бумаге открывается не позднее чем за 10 минут до начала аукциона закрытия.
 12. При проведении торгов методом дискретного аукциона:
 - 1) продолжительность периода приема Биржей заявок составляет не более 10 минут;
 - 2) в торговую систему подаются лимитированные заявки;
 - 3) период приема Биржей заявок заканчивается в произвольный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, но не ранее чем по истечении 9 минут 30 секунд с момента его начала.
 13. При проведении торгов методом непрерывного встречного аукциона для отдельных групп финансовых инструментов настоящим Регламентом или настройками торговой системы может быть установлен перевод торгов в конце торгового дня в аукцион закрытия с целью формирования репрезентативного значения цены закрытия торгового дня.
 14. Аукцион закрытия проводится по ценным бумагам, торгующимся в режимах торгов, в которых сделки купли-продажи заключаются методом непрерывного встречного аукциона.
 15. Аукцион закрытия начинается за 15 минут до окончания торгового дня и состоит из следующих последовательных периодов:
 - 1) прием Биржей заявок;
 - 2) заключение сделок по цене аукциона закрытия.
 16. При проведении аукциона закрытия:
 - 1) период приема Биржей заявок начинается за 15 минут до окончания торгового дня и завершается по истечении 10 минут с момента его начала;
 - 2) на основании поданных заявок в случайный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, не превышающий 30 секунд с момента завершения периода приема Биржей заявок, определяется цена аукциона закрытия, и заключаются сделки по такой цене;
 - 3) в случае если цена аукциона закрытия в соответствии с подпунктом 2) настоящего пункта не определена, настройками торговой системы начинается дополнительный период приема заявок продолжительностью три минуты;
 - 4) на основании поданных заявок в случайный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, не превышающий 30 секунд с момента завершения периода приема Биржей заявок, определяется цена аукциона закрытия, и заключаются сделки по такой цене;
 - 5) по окончании заключения сделок, предусмотренных подпунктом 4) настоящего пункта, торговая система принимает заявки по цене

аукциона закрытия, на основе которых заключаются сделки по такой цене;

- б) время окончания приема заявок и заключения сделок по цене аукциона закрытия совпадает со временем окончания торгового дня финансовыми инструментами.

Статья 7. 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 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.

Глава 2. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ИНОСТРАННЫМИ ВАЛЮТАМИ

Статья 8. Торговый день

Торговый день по иностранным валютам начинается в 10.15 алматинского времени, заканчивается в 17.00 алматинского времени (с учетом условий, установленных пунктами 2 и 3 статьи 6 настоящего Регламента) и установлен приложением 1 к настоящему Регламенту.

Статья 9. Частные параметры проведения торгов долларом США

1. Доллар США торгуется с расчетами в тенге и сроками осуществления расчетов T+0¹, T+1 и T+2 (далее обозначается соответственно как "USDKZT_TOD", "USDKZT_TOM" и "USDKZT_SPT"²).
2. 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 Республики Казахстан, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в долларах США и в тенге, следующий за нерабочим днем.

¹ 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).

² 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.

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 Республики Казахстан.

4. Размер лота при проведении торгов долларом США методом непрерывного встречного аукциона зависит от величины отклонения цены поданной заявки от цены последней сделки и установлен приложением 2 к настоящему Регламенту (с учетом особенности, установленной абзацем вторым настоящего пункта).

Размер лота при проведении торгов USDKZT_TOM методом франкфуртского аукциона составляет 1.000 долларов США.

5. При проведении торгов долларом США его цена измеряется в казахстанских тенге за один доллар США с точностью до второго знака после запятой.
6. 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.
7. При проведении торгов долларом США преодолимый лимит отклонения цены не установлен.
8. Дополнительные методы проведения торгов долларом США не установлены.

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

Статья 10. 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. 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.

3. 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан.

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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан.

4. Размер лота при проведении торгов евро составляет 1 000 евро.
5. 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.
6. 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.
7. При проведении торгов евро установлен преодолимый лимит отклонения цены в размере 3 % от цены последней сделки.
8. Дополнительные методы проведения торгов евро не установлены.
Резервным методом проведения торгов евро является метод фиксинга.

Статья 11. 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. Торги RUBKZT_TOD не проводятся в случае, если день торгов по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по рублю нерабочим днем.
3. 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан.

4. Размер лота при проведении торгов российским рублем составляет 50 000 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.

Статья 12. 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.
3. 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан, 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 Республики Казахстан.

4. Размер лота при проведении торгов юанем составляет 5 000 юаней.

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 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 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_01W³, USDKZT_01M, USDKZT_03M, USDKZT_06M или USDKZT_01Y как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).
2. На дополнительной сессии:
 - 1) осуществляются операции валютного свопа в отношении доллара США только с Национальным Банком Республики Казахстан;
 - 2) операции валютного свопа осуществляются со сроком исполнения только 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.
3. 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);

³ 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) сделки с EURKZT_TOM или EURKZT_SPT как сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (сделок, которыми завершаются (закрываются) операции валютного свопа).
4. 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.
5. 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).
6. 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.
7. 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).
8. Размер лота при осуществлении операций валютного свопа составляет 10 000 единиц валюты, являющейся предметом операции валютного свопа.
9. 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.
10. 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.
11. 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 ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 14. Торговый день

Торговый день по ценным бумагам установлен приложением 3 к настоящему Регламенту.

Статья 15. Частные параметры проведения торгов ценными бумагами

1. Открытие торгов по ценным бумагам либо изменение каких-либо параметров ценных бумаг в соответствии с заявлением инициатора допуска данных ценных бумаг осуществляется по решению члена Правления Биржи, курирующего подразделение торгов, в течение трех рабочих дней с даты получения такого заявления или с даты, указанной в заявлении инициатора допуска данных ценных бумаг (в случае если такая дата превышает три рабочих дня).
2. Если иное не установлено решением члена Правления Биржи, курирующего подразделение торгов, в отношении ценной бумаги какого-либо отдельного наименования, стандартный размер лота при проведении торгов ценными бумагами установлен в размере одной ценной бумаги за следующими исключениями:
 - 1) при проведении торгов паями размер лота составляет целый пай либо долю пая. Коэффициент дробления размер лота составляет не менее одной миллионной доли пая¹. Размер лота в заявке устанавливается инициатором допуска таких паев;
 - 2) при проведении торгов облигациями, номинированными в иностранной валюте, сделки по которым рассчитываются в валюте выпуска, стандартный размер лота установлен в размере 1 000 ценных бумаг;
 - 3) при проведении торгов с ценной бумагой какого-либо отдельного наименования в режиме торгов "Мелкие лоты" размер лота не может превышать установленный для данной ценной бумаги размер стандартного лота.
3. Если иное не установлено решением члена Правления Биржи, курирующего подразделение торгов в отношении ценной бумаги какого-либо отдельного наименования, при проведении торгов:
 - 1) акциями и паями цена измеряется в казахстанских тенге либо долларах США (в зависимости от валюты, указанной в заявлении инициатора допуска ценных бумаг) за одну акцию или пай с точностью до второго знака после запятой;
 - 2) облигациями цена измеряется с точностью до четвертого знака после запятой;
 - 3) производными ценными бумагами цена измеряется в единицах валюты их размещения за одну производную ценную бумагу с точностью до второго знака после запятой.
4. Торги облигациями, включенными в официальный список Биржи, и облигациями, допущенными к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги" (далее в настоящей статье – нелистинговые облигации) проводятся в "чистых" либо в "грязных" ценах в зависимости от критерий, установленных внутренним документом Биржи "Методика расчета доходности облигаций и сумм сделок с облигациями".
5. Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля облигациями какого-либо наименования, определяются решением члена Правления Биржи, курирующего подразделение торгов, принимаемыми в связи с открытием торгов облигациями данного наименования, с учетом особенности, установленной абзацем вторым настоящего пункта.

Цены ("чистые" или "грязные"), по которым осуществляется торговля нелистинговыми облигациями, определяются в порядке, установленном внутренним документом Биржи.
6. В качестве цены открытия торговой сессии по каким-либо ценным бумагам используется цена, определенная на аукционе открытия, если она не

определена, то используется цена первой сделки с этими ценными бумагами, заключенной на торговой сессии по окончании аукциона открытия.

7. За 15 минут до завершения торгов ценными бумагами проводится аукцион закрытия.
8. В случае если день исполнения сделок купли-продажи с ценными бумагами, расчет по которым осуществляется в долларах США, по каким-либо причинам является для банков – корреспондентов Биржи по доллару США нерабочим днем, то днем исполнения таких сделок является рабочий день Республики Казахстан, в который банки – корреспонденты Биржи осуществляют расчеты в долларах США, следующий за нерабочим днем.
9. Дополнительным методом проведения торгов ценными бумагами является метод заключения прямых сделок.

Резервным методом проведения торгов ценными бумагами является метод фиксинга.

Глава 4. 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. Методы проведения торгов государственными пакетами акций определяются продавцами данных государственных пакетов акций по согласованию с Биржей.

Глава 5. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ ФЬЮЧЕРСАМИ

Статья 16. Торговый день

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

Статья 17. Частные параметры проведения торгов фьючерсами

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

Глава 6. ЧАСТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НА РЫНКЕ РЕПО

Статья 18. Торговый день по операциям репо

1. Торговый день по операциям репо установлен приложением 3 к настоящему Регламенту.

Торговый день по операциям репо, осуществляемым "прямым" способом, на отдельные торговые сессии не подразделяется; торги проводятся в одну торговую сессию, совпадающую по своей продолжительности с торговым днем.

Торговый день по операциям репо, осуществляемым "автоматическим" способом, подразделяется на основную и дополнительную сессии.

2. Торги по операциям репо, в качестве предметов которых используются ценные бумаги (в том числе производные ценные бумаги, базовым активом которых являются негосударственные ценные бумаги), номинированные в долларах США, не проводятся, в случае если по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи по доллару США не осуществляют расчеты в долларах США в день торгов.
3. Отчет на исполнение сделки закрытия репо, относящейся к операции репо, по которой Биржа не исполняет функции центрального контрагента, должен быть направлен в торговую систему продавцом репо за 15 минут до окончания торгового дня по такой операции репо.

Статья 19. 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) размер лота соответствует размеру, установленному для ценной бумаги, используемой в качестве предмета такой операции репо в соответствии с пунктом 2 статьи 15 настоящего Регламента;
- 2) цена операции репо измеряется с точностью до четвертого знака после запятой;
- 3) цена открытия репо определяется исходя из рыночной либо индикативной стоимости данных ценных бумаг;
- 4) срок операции репо (дата закрытия репо) определяется участниками операции репо самостоятельно по согласованию друг с другом;
- 5) дополнительные и резервные методы проведения торгов при осуществлении репо "прямым" способом не существуют.

Статья 20. Частные параметры проведения торгов при осуществлении операций репо "автоматическим" способом

1. Размер лота при осуществлении операций репо "автоматическим" способом с:
 - 1) отдельным наименованием ценных бумаг составляет одну ценную бумагу;
 - 2) какой-либо корзиной ценных бумаг составляет 1 000 000 тенге.
2. При проведении торгов на рынке автоматического репо цена операции репо (в качестве которой используется ставка операции репо) измеряется с точностью до четвертого знака после запятой.
3. В качестве цены открытия торговой сессии используется:
 - 1) средневзвешенная доходность всех операций репо с этим сроком исходя из сделок их открытия, заключенных на последней результативной торговой сессии, если в качестве предметов данных операций используются государственные ценные бумаги Республики Казахстан (за исключением ценных бумаг местных исполнительных органов);
 - 2) ставка операции репо с этим сроком исходя из сделки открытия, заключенной на данной торговой сессии, если в качестве предметов данных операций используются иные, чем указанные в подпункте 1) настоящего пункта, ценные бумаги.
4. Дополнительные методы проведения торгов при осуществлении операций репо "автоматическим" способом не установлены.

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

Глава 7. 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 8. РЕГЛАМЕНТ РАБОТЫ СИСТЕМЫ КОНТРОЛЯ И ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 21. Регламент работы системы контроля и обеспечения

1. Система контроля и обеспечения работает ежедневно по рабочим дням Республики Казахстан в установленное приложением 3 к настоящему Регламенту время.
2. Время работы системы контроля и обеспечения может быть продлено Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим проведение торгов, в случае сбоя в работе программно-технических средств Биржи, используемых при проведении торгов и приеме сообщений о подтверждении сделок, или возникновении иных непредвиденных обстоятельств, препятствующих работе системы контроля и обеспечения в обычном режиме.

Статья 22. Особенности работы системы контроля и обеспечения

1. При проведении торгов методом специализированных торгов подлежат подтверждению либо отказу в подтверждении 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 контроля и обеспечения.
2. При проведении торгов методом специализированных торгов, в рамках которых в торговую систему подаются прямые заявки, в случае необходимости Биржа должна получить 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.
3. При проведении торгов методом специализированных торгов по размещению (продаже, выкупу, приобретению) или доразмещению ценных бумаг, в рамках которых в торговую систему подаются иные, чем прямые заявки, Биржа должна получить подтверждения или отказы от подтверждения данных заявок только в период приема данных заявок.

4. При проведении торгов по ценным бумагам, при заключении сделок с которыми Биржа не исполняет функции центрального контрагента, подтверждение сделок осуществляется согласно внутреннему документу Биржи "Порядок заключения сделок с ценными бумагами без исполнения функций центрального контрагента и осуществления расчетов по ним (гросс-расчеты)".
5. При проведении торгов по ценным бумагам, при заключении сделок с которыми Биржа исполняет функции центрального контрагента, порядок заключения и исполнения сделок в интересах клиентов пользователя системы контроля и обеспечения осуществляется согласно внутреннему документу "Порядок заключения сделок с ценными бумагами с исполнением функций центрального контрагента".

Глава 9. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Настоящий Регламент подлежит опубликованию на интернет-ресурсе Биржи.
2. Ответственность за своевременное внесение в настоящий Регламент изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на подразделение торгов.
3. Настоящий Регламент подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза каждые три года, исчисляемые с даты введения в действие настоящего Регламента.

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.

Приложение 1

к Регламенту торгов и работы
системы контроля и
обеспечения

ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ
на валютном рынке

№ п/п	Финансовый инструмент	Торговый код финансового инструмента	Время проведения торгов, (ALT)
1	2	3	4
1.	Иностранные валюты со сроком осуществления расчетов T+0	USDKZT_TOD, RUBKZT_TOD, EURKZT_TOD, EURUSD_TOD	10.15 – 15.30
2.	Китайский юань со сроком осуществления расчетов T+0	CNYKZT_TOD	10.15 – 11.00
3.	Иностранные валюты со сроками осуществления расчетов T+1 и T+2	USDKZT_TOM, USDKZT_SPT, RUBKZT_TOM, RUBKZT_SPT, EURKZT_TOM, EURKZT_SPT, EURUSD_TOM, EURUSD_SPT, CNYKZT_TOM, CNYKZT_SPT	10.15 – 17.00
4.	Основная сессия по операциям валютного свопа в отношении доллара США	USDKZT_0_001, USDKZT_0_002, USDKZT_1_002, USDKZT_0_01W, USDKZT_0_01M, USDKZT_0_06M, USDKZT_0_01Y	11.30 – 15.30
5.	Дополнительная сессия по операциям валютного свопа в отношении доллара США	USDKZT_0_001	17.00 – 17.30
6.	Операции валютного свопа в отношении евро и рубля	EURKZT_0_001, EURKZT_0_002, EURKZT_1_002, RUBKZT_0_001, RUBKZT_0_002, RUBKZT_1_002	11.30 – 15.30

Регламент торгов и работы системы контроля и обеспечения

№ п/п	Финансовый инструмент	Торговый код финансового инструмента	Время проведения торгов, (ALT)
1	2	3	4
7.	Операции валютного свопа в отношении китайского юаня	CNYKZT_0_001, CNYKZT_0_002, CNYKZT_1_002	10.15 – 11.00

Приложение 2

к Регламенту торгов
и работы системы контроля
и обеспечения

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 3

к Регламенту торгов и работы системы контроля и обеспечения

**ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ
и работы системы контроля и обеспечения на фондовом рынке**

№ п/п	Наименование операции	Время проведения торгов, (ALT)		Время работы системы контроля и обеспечения, (ALT)
		Метод непрерывного встречного аукциона	Метод заключения прямых сделок	
1	2	3		4
1.	Купля-продажа ценных бумаг (день расчетов T+n)	11.20 – 17.30	10.30 – 17.30	11.30 – 17.45
2.	Купля-продажа ценных бумаг (день расчетов T0)	11.20 – 17.00	10.30 – 17.30 <i>(данная ячейка изменена решением Правления Биржи от 14 июля 2020 года)</i>	
3.	Купля-продажа ценных бумаг, допущенных к режиму торгов "Мелкие лоты"	15.00 – 17.00	–	
4.	Операции репо	11.30 – 17.00	10.30 – 17.00	
5.	Операции репо на дополнительной сессии с корзиной НБРК	17.00 – 17.30	–	