АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 09 июня 2020 года № 78)

Введена в действие

с 03 августа 2020 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ

операций репо, осуществляемых "автоматическим" способом

г. Алматы

2020

ЛИСТ ПОПРАВОК

1. **Изменения № 1:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 15 декабря 2021 года № 134);
   - введены в действие с 20 декабря 2021 года.
2. **Изменение № 2:**
   - утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 марта 2022 года № 36);
   - введено в действие с 11 марта 2022 года.
3. **Изменения и дополнения № 3:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 18 июля 2022 года № 88);
   - введены в действие с 22 августа 2022 года.
4. **Изменения № 4:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 20 октября 2022 года № 121);
   - введены в действие:

     пункт 1 изменений – с 23 января 2023 года;

     пункт 2 изменений – с 26 октября 2022 года.
5. **Изменения и дополнения № 5:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 15 августа 2023 года № 85);
   - введены в действие с 25 сентября 2023 года.
6. **Изменения и дополнения № 6:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 21 июня 2024 года № 72);
   - введены в действие с 21 июня 2024 года.
7. **Изменения и дополнения № 7:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 25 декабря 2024 года № 152);
   - введены в действие с 30 декабря 2024 года.

Настоящая Спецификация разработана в соответствии с внутренним документом АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) "Правила осуществления операций репо в торгово-клиринговой системе ASTS+" и определяет основные характеристики операций репо, осуществляемых "автоматическим" способом.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящей Спецификации использованы понятия, определенные Правилами осуществления операций репо в торгово-клиринговой системе ASTS+ и другими внутренними документами Биржи.

2. Для целей настоящей Спецификации под операцией репо понимается только операция репо, осуществляемая "автоматическим" способом.

3. При осуществлении операций репо разрешается использовать казахстанский тенге либо доллар США в зависимости от режима торгов, в котором осуществляются такие операции репо.

4. В зависимости от режима торгов операции репо осуществляются с участием центрального контрагента (далее – с ЦК) и без участия центрального контрагента (далее – без ЦК) *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*.

5. Как финансовые инструменты операции репо подразделяются следующим образом:

   1) операции репо с одним и тем же сроком, являющиеся одним финансовым инструментом вне зависимости от наименований ценных бумаг, являющихся предметами этих операций репо (далее – корзина ГЦБ[1] с ЦК, корзина НБРК[2] с ЦК, корзина ОДГУ[3] с ЦК и корзина ГЦБ без ЦК);

   2) операции репо в отношении каждого отдельного наименования ценных бумаг с различными сроками, являющиеся различными финансовыми инструментами.

5-1. Стандартизированные сроки операций репо, осуществляемых "автоматическим" способом, составляют:

   1) один, два, три, семь, 14 (четырнадцать), 30 (тридцать) и 90 (девяносто) дней по операциям репо с корзиной ГЦБ с ЦК и операциям репо с корзиной ОДГУ с ЦК;

   2) один день по операциям репо с корзиной НБРК с ЦК;

   3) один, два, три, семь, 14 (четырнадцать) и 30 (тридцать) дней по операциям репо с корзиной ГЦБ без ЦК, операциям репо с ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг (за исключением операций репо с ЦК с КСУ[4]) и операциям репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг с расчетами в казахстанских тенге (с учетом особенности, установленной пунктом 5-2 настоящей Спецификации) *(данный подпункт изменен решением Правления Бирж от 25 декабря 2024 года)*;

   4) один, семь, 14 (четырнадцать) и 30 (тридцать) дней по операциям репо с ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг с расчетами в долларах США *(данный подпункт изменен решениями Правления Биржи от 20 октября 2022 года и от 15 августа 2023 года)*;

   5) один, два, три, семь, 14 (четырнадцать), 30 (тридцать), 60 (шестьдесят) и 90 (девяносто) дней для операций репо с ЦК с КСУ в казахстанских тенге;

---

[1] Условное обозначение словосочетания "государственные ценные бумаги".

[2] Условное обозначение словосочетания "Национальный Банк Республики Казахстан".

[3] Условное обозначение словосочетания "облигации эмитента с долей государственного участия".

6) один, два, три, семь, 14 (четырнадцать) и 30 (тридцать) дней по операциям репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг с расчетами в долларах США.

(Данный пункт включен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года).

5-2. Стандартизированными сроками операций репо с ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг, в качестве которых используются государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, с валютой расчетов в казахстанских тенге составляют один и два дня.

(Данный пункт включен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года).

6. Участниками операций репо могут быть клиринговые участники фондового рынка, имеющие право участия в торгах теми ценными бумагами, которые разрешены в соответствии с настоящей Спецификацией и с учетом особенности, установленной пунктом 7 настоящей Спецификации.

7. При осуществлении операций репо с корзиной НБРК одной из сторон является Национальный Банк Республики Казахстан, второй стороной могут быть банки второго уровня и АО "Казпочта", являющиеся клиринговыми участниками фондового рынка.

   При этом Национальный Банк Республики Казахстан объявляет твердые котировки, иные участники торгов могут заключать сделки только по котировкам, объявленным Национальным Банком Республики Казахстан.

8. Коды операций репо как финансовых инструментов в торгово-клиринговой системе устанавливаются в соответствии с внутренним документом Биржи "Инструкция о порядке присвоения кодов членам АО "Казахстанская фондовая биржа" и их счетам, пользователям торговых систем, эмитентам ценных бумаг и финансовым инструментам".

9. Для целей настоящей Спецификации признаются рейтинговые оценки агентства "Standard&Poor's" или агентств "Moody'sInvestorsService" и "Fitch", или их дочерних рейтинговых организаций (далее – другие рейтинговые агентства).

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

Глава 2. ПРЕДМЕТЫ ОПЕРАЦИЙ РЕПО

10. В качестве предметов операций репо с корзиной ГЦБ с ЦК и с корзиной НБРК с ЦК могут быть использованы ценные бумаги нижеперечисленных видов, соответствующие следующим условиям (с учетом особенностей, установленных пунктами 15 и 16 настоящей Спецификации):

    1) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, и находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи;

    2) долговые ценные бумаги, находящиеся в официальном списке Биржи, выпущенные международными финансовыми организациями, разрешенные к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан6, номинальная стоимость которых не превышает 1 000 тенге, или размер такой стоимости эквивалентен 1 000 тенге в иностранной валюте;

    3) долговые ценные бумаги, 100 % голосующих акций эмитента, которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан.

11. В качестве предметов операций репо с корзиной ОДГУ с ЦК могут быть использованы следующие долговые ценные бумаги, находящиеся в официальном списке Биржи, номинированные в тенге, эмитент которых является (с учетом особенности, установленной пунктом 16 настоящей Спецификации):

    1) национальной компанией Республики Казахстан;

    2) организацией, 75 и более процентов от общего количества размещенных акций или от оплаченного уставного капитала которой принадлежат государству, национальному холдингу либо национальному управляющему холдингу;

    3) организацией, 75 и более процентов от общего количества размещенных акций или от оплаченного уставного капитала которой принадлежат дочерней организации национального холдинга либо дочерней организации национального управляющего холдинга.

(Данный пункт изменен решением правления Биржи от 10 марта 2022 года)

12. В качестве предметов операций репо в отношении отдельного наименования ценных бумаг с ЦК с валютой расчетов в казахстанских тенге могут быть использованы:

    1) ценные бумаги нижеперечисленных видов, находящиеся в официальном списке Биржи, расчеты по сделкам купли-продажи с которыми осуществляются в казахстанских тенге (с учетом особенности, установленной пунктом 16 настоящей Спецификации):

    акции;

    долговые ценные бумаги;

    ценные бумаги международных финансовых организаций;

    ценные бумаги инвестиционных фондов;

    паи;

    депозитарные расписки;

    государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, и находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи;

    иностранные государственные ценные бумаги, находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи;

    2) клиринговые сертификаты участия.

(Данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 18 июля 2022 года и от 25 декабря 2024 года)

12-1. В качестве предметов операций репо в отношении отдельного наименования ценных бумаг с ЦК с валютой расчетов в долларах США могут быть использованы ценные бумаги нижеперечисленных видов, находящиеся в официальном списке Биржи, расчеты по сделкам купли-продажи с которыми осуществляются в долларах США (с учетом особенности, установленной пунктом 16 настоящей Спецификации):

акции;

долговые ценные бумаги;

ценные бумаги международных финансовых организаций;

ценные бумаги инвестиционных фондов;

паи;

депозитарные расписки;

государственные ценные бумаги, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан в соответствии с законодательством иностранного государства, и находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи;

иностранные государственные ценные бумаги, находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи.

(Данный пункт включен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)

13. В качестве предметов операций репо с корзиной ГЦБ без ЦК могут быть использованы ценные бумаги нижеперечисленных видов, соответствующие следующим условиям (с учетом особенности, установленной пунктом 15 настоящей Спецификации):

1) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, и находящиеся в секторе "государственные ценные бумаги" официального списка Биржи;

2) долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, разрешенные к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан[4], номинальная стоимость которых не превышает 1 000 тенге, или размер такой стоимости эквивалентен 1 000 тенге в иностранной валюте, находящиеся в официальном списке Биржи, и эмитент которых имеет рейтинговую оценку не ниже "BBB-" по международной шкале рейтингового агентства Standard&Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня по международной шкале других рейтинговых агентств;

3) долговые ценные бумаги, находящиеся в официальном списке Биржи, эмитент которых имеет рейтинговую оценку не ниже "BBB" по международной шкале рейтингового агентства Standard&Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня по международной шкале других рейтинговых агентств и 100 % голосующих акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан;

4) долговые ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, разрешенные к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан[5], номинальная стоимость которых не превышает 1 000 тенге, или размер такой стоимости эквивалентен 1 000 тенге в иностранной валюте, находящиеся в официальном списке Биржи, и размер доли Республики Казахстан в капитале данной международной финансовой организации составляет не менее 30 % *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 21 июня 2024 года)*.

14. В качестве предметов операций репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг с валютой расчетов казахстанский тенге могут быть использованы акции Списка Т+, условия включения в который установлены внутренними документами клиринговой организации *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 15 декабря 2021 года и от 15 августа 2023 года)*.

14-1. В качестве предметов операций репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг с валютой расчетов доллар США могут быть использованы следующие ценные бумаги, находящиеся в официальном списке Биржи, расчеты по сделкам купли-продажи с которыми осуществляются в долларах США:

1) акции;

2) ценные бумаги инвестиционных фондов;

4) паи;

5) депозитарные расписки.

---

[5] Пункт 1 постановления Правления Национального Банка Республики Казахстан "Об установлении перечня международных финансовых организаций, облигации которых банки и банковские холдинги приобретают в собственность, и требований к облигациям, которые банки и банковские холдинги приобретают в собственность" от 29 ноября 2017 года № 234 *(нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*.

(Данный пункт включен решением Правления Биржи от 15 декабря 2021 года)

15. В качестве предметов операций репо не используются государственные долгосрочные сберегательные казначейские обязательства Республики Казахстан (МЕУЖКАМ) в течение всего срока их обращения.

16. Ценные бумаги (за исключением клиринговых сертификатов участия) допускаются к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК в случае их нахождения в Списке Т+ *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 18 июля 2022 года и от 15 августа 2023 года)*.

Глава 3. ВКЛЮЧЕНИЕ ЦЕННЫХ БУМАГ В ЧИСЛО РАЗРЕШЕННЫХ К ИСПОЛЬЗОВАНИЮ В КАЧЕСТВЕ ПРЕДМЕТОВ ОПЕРАЦИЙ РЕПО

17. Ценные бумаги из числа указанных в подпунктах 2) и 3) пункта 10, пункте 11, подпункте 1) пункта 12 и пункте 12-1 настоящей Спецификации, допускаются к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК со дня их включения в Список Т+ посредством установления подразделением торгов необходимых настроек торгово-клиринговой системы в порядке, установленном внутренним документом Биржи *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 18 июля 2022 года и от 25 декабря 2024 года)*.

17-1. Ценные бумаги из числа указанных в подпункте 2) пункта 12 настоящей Спецификации допускаются к использованию в качестве предметов операций репо на основании решения Правления о формировании имущественного пула и выпуске клиринговых сертификатов участия в рамках данного имущественного пула *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*.

18. Ценные бумаги из числа указанных в подпункте 1) пункта 10 и подпункте 1) пункта 13 настоящей Спецификации допускаются к использованию в качестве предметов операций репо с корзиной ГЦБ с ЦК и корзиной ГЦБ без ЦК по мере их включения в официальный список Биржи посредством установления подразделением торгов необходимых настроек торгово-клиринговой системы одновременно с настройками, осуществляемыми при включении данных ценных бумаг в официальный список Биржи *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*.

19. Ценные бумаги из числа указанных в подпунктах 2)-4) пункта 13 настоящей Спецификации допускаются к использованию в качестве предметов операций репо с корзиной ГЦБ без ЦК по мере их включения в официальный список Биржи после получения служебной записки от подразделения мониторинга, подтверждающей соответствие ценных бумаг и их эмитента условиям, установленным пунктом 25 настоящей Спецификации, посредством установления подразделением торгов необходимых настроек торгово-клиринговой системы *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 21 июня 2024 года)*.

20. Ценные бумаги, указанные в пункте 14 настоящей Спецификации, допускаются к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг на второй рабочий день после получения Биржей соответствующего заявления члена Биржи "фондовой" категории *(данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 15 декабря 2021 года и от 15 августа 2023 года)*.

    Ценные бумаги, указанные в пункте 14-1 настоящей Спецификации, допускаются к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК в отношении отдельного наименования ценных бумаг на основании соответствующего заявления члена Биржи "фондовой" категории и служебной записки, подготовленной подразделением мониторинга не позднее рабочего дня, следующего за днем получения такого заявления, подтверждающей соответствие указанных ценных бумаг и их эмитента условиям, установленным пунктом 25 настоящей Спецификации *(данный абзац включен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)*.

21. Служебная записка, указанная в пунктах 19 и 20 настоящей Спецификации, должна быть согласована с членами Правления Биржи, курирующими подразделение мониторинга и подразделение торгов *(данный абзац изменен решениями Правления Биржи от 15 августа 2023 года и от 25 декабря 2024 года)*.

Подразделение торгов осуществляет настройки торгово-клиринговой системы, обеспечивающие допуск ценных бумаг, установленных подпунктами 2)–4) пункта 13 и пунктом 14-1 настоящей Спецификации, к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК, в течение трех рабочих дней с даты получения служебной записки от подразделения мониторинга *(данный абзац изменен решениями Правления Биржи от 21 июня 2024 года и от 25 декабря 2024 года)*.

Если в отношении названных ценных бумаг и/или их эмитента не соблюдаются соответствующие условия использования в качестве предметов операций репо без ЦК подразделение мониторинга официальным письмом уведомляет члена Биржи, указанного в пункте 20 настоящей Спецификации, о невозможности использования названных ценных бумаг в качестве предмета операций репо.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 15 декабря 2021 года)

22. Ценные бумаги, используемые в качестве предметов операций репо с какой-либо корзиной ценных бумаг с расчетами в какой-либо валюте, запрещается допускать к использованию в качестве предметов операций репо в отношении отдельного наименования ценных бумаг с расчетами в данной валюте *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*.

23. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года).*

24. Заявление члена Биржи об использовании ценных бумаг какого-либо наименования в качестве предметов операций репо составляется в произвольной форме и должно соответствовать следующим требованиям:

    1) содержит сведения о ценных бумагах данного наименования, позволяющие Бирже их однозначно идентифицировать;

    2) подписано лицом, которое обладает правом подписи от имени этого члена Биржи в соответствии с имеющимся у нее документом с образцами подписей (подлинность которых засвидетельствована уполномоченным на то работником Биржи или нотариально), заверено оттиском печати (при ее наличии) этого члена Биржи.

25. Ценные бумаги какого-либо наименования допускаются к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК при условиях, что *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 15 декабря 2021 года)*:

    1) в отношении ценных бумаг данного наименования соблюдаются применимые условия из числа установленных подпунктами 2)–4) пункта 13 настоящей Спецификации *(данный подпункт исключен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года и включен решением Правления Биржи от 21 июня 2024 года)*;

    2) известна ставка купонного вознаграждения по облигациям на срок продолжительности операции репо;

    3) ценные бумаги данного наименования и их эмитент полностью соответствуют базовым листинговым требованиям[5] той категории, сектора и площадки, по которым ценные бумаги данного наименования находятся в официальном списке Биржи;

    4) ценные бумаги данного наименования не подпадают под действие запрета, установленного пунктом 27 настоящей Спецификации;

    5) по ценным бумагам данного наименования осуществляется расчет расчетной цены в соответствии с внутренним документом клиринговой организации, регламентирующим порядок определения риск-параметров финансовых инструментов *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*.

26. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*.

---

[6] Базовые листинговые требования – требования, которые установлены законодательством Республики Казахстан к эмитентам и выпущенным ими ценным бумагам для включения ценных бумаг в официальный список Биржи и их нахождения в нем *(нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*.

27. Запрещаются к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК ценные бумаги любых наименований из числа указанных в подпунктах 2)–4) пункта 13, пунктов 14 и 14-1 настоящей Спецификации видов, выпущенные каким-либо эмитентом, при возникновении любого из следующих оснований *(данный абзац изменен решениями Правления Биржи от 15 декабря 2021 года и от 21 июня 2024 года)*:

    1) у данного эмитента появились неисполненные обязательства с истекшими сроками исполнения перед держателями любых выпущенных им ценных бумаг;

    2) у инициатора допуска ценных бумаг, выпущенных данным эмитентом, появилось неисполненное в течение трех месяцев после установленного листинговым договором срока обязательство перед Биржей по предоставлению финансовой отчетности данного эмитента (в том числе промежуточной);

    3) у инициатора допуска ценных бумаг, выпущенных данным эмитентом, появилось неисполненное в течение десяти дней после установленного внутренним документом Биржи "Правила раскрытия информации инициаторами допуска ценных бумаг" срока обязательство перед Биржей по предоставлению существенной информации о данном эмитенте и/или выпущенных им ценных бумагах, подлежащей предоставлению Бирже согласно этой статье *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 15 декабря 2021 года)*.

28. Ценные бумаги, выпущенные каким-либо эмитентом, перестают подпадать под действие запрета, установленного пунктом 27 настоящей Спецификации, при устранении данным эмитентом или инициатором (инициаторами) допуска выпущенных данным эмитентом ценных бумаг нарушения (нарушений), в связи с которым эти ценные бумаги подпали под действие указанного запрета (с учетом особенности, установленной абзацем вторым настоящего пункта).

    В случае если ценные бумаги, выпущенные каким-либо эмитентом, подпали под действие запрета, установленного пунктом 27 настоящей Спецификации, по основанию, указанному в подпункте 1) пункта 27 настоящей Спецификации, они перестают подпадать под действие указанного запрета только после получения Биржей документов, подтверждающих полное исполнение данным эмитентом соответствующих обязательств перед держателями выпущенных им ценных бумаг (в том числе по неустойкам, пеням и штрафам), предусмотренным применимым законодательством, проспектами выпусков ценных бумаг или иными документами, аналогичными по своему назначению проспектам выпусков ценных бумаг), либо иное полное урегулирование данным эмитентом обязательств.

Глава 4. ДИСКОНТИРОВАНИЕ ЦЕННЫХ БУМАГ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ В КАЧЕСТВЕ ПРЕДМЕТА ОПЕРАЦИИ РЕПО БЕЗ ЦК

29. Для определения количества предмета операции репо, точной суммы сделки открытия, цен открытия и закрытия, а также суммы сделки закрытия операции репо расчетные цены ценных бумаг, используемых в качестве предмета операции репо без ЦК, в зависимости от типа этих ценных бумаг дисконтируются:

    1) номинированных в тенге дисконтных государственных ценных бумаг (ГЦБ), выпущенных Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан – на 3 %;

    2) номинированных в тенге неиндексированных ГЦБ, выпущенных Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан с фиксированной ставкой купона, до погашения которых с даты оценки осталось:

    не более трех лет – на 3 %;

    от трех лет и более – на 5 %;

    3) ГЦБ, выпущенных Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, номинированных в иностранной валюте, или ГЦБ,

выпущенных Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, номинированных в казахстанских тенге и индексированных по уровню изменения курса тенге к какой-либо иностранной валюте, до погашения которых с даты оценки осталось:

не более 360 дней – на 10 %;

361 день и более – на 15 %;

4) номинированных в тенге ГЦБ, выпущенных Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан с индексированной по уровню инфляции ставкой купона либо ставкой купона, индексированной к ставке TONIA, до погашения которых с даты оценки осталось:

не более 360 дней, – на 10 %;

361 день и более – на 15 %;

(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 20 октября 2022 года)

5) долговых ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями и разрешенных к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан, находящихся в официальном списке Биржи и рейтинг эмитента которых имеет оценку не ниже "AA" по международной шкале рейтингового агентства Standard&Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня по международной шкале других рейтинговых агентств, до погашения которых с даты оценки осталось:

не более трех лет – на 3 %;

от трех и более лет – на 5 %;

6) долговых ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями и разрешенных к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан, находящихся в официальном списке Биржи и рейтинг эмитента которых имеет оценку от "AA-" до "BBB-" по международной шкале рейтингового агентства Standard&Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня по международной шкале других рейтинговых агентств, до погашения которых с даты оценки осталось:

до года – на 5 %;

от одного года до трех лет – на 10 %;

от трех и более лет – на 20 %;

6-1) долговых ценных бумаг, выпущенных международной финансовой организацией, при этом размер доли Республики Казахстан в капитале данной организации составляет не менее 30 %, разрешенных к приобретению в соответствии с законодательством Республики Казахстан, и находящихся в официальном списке Биржи, до погашения которых с даты оценки осталось:

до года – на 5 %;

от одного года до трех лет – на 10 %;

от трех и более лет – на 20 %;

(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 21 июня 2024 года)

7) долговых ценных бумаг, эмитент которых имеет рейтинговую оценку не ниже "BBB" по международной шкале рейтингового агентства Standard&Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня по международной шкале других рейтинговых агентств и 100 % голосующих акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан, до погашения которых с даты оценки осталось *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 21 июня 2024 года)*:

до года – на 5 %;

от одного года и до трех лет – на 10 %;

от трех и более лет – на 20 %;

8) акций, ценных бумаг инвестиционных фондов, паев, депозитарных расписок – на 30 % *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 15 декабря 2021 года)*.

30. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*.

Глава 6. ПРОЦЕДУРА ИСКЛЮЧЕНИЯ ЦЕННЫХ БУМАГ ИЗ ЧИСЛА РАЗРЕШЕННЫХ К ИСПОЛЬЗОВАНИЮ В КАЧЕСТВЕ ПРЕДМЕТОВ ОПЕРАЦИЙ РЕПО

31. Ценные бумаги какого-либо наименования (за исключением клиринговых сертификатов участия) исключаются из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК при возникновении любого из следующих оснований *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*:

1) в отношении ценных бумаг данного наименования перестали соблюдаться применимые условия из числа установленных пунктами 10–12-1 настоящей Спецификации *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)*;

2) ценные бумаги данного наименования исключены из официального списка Биржи.

31-1. Клиринговые сертификаты участия, выпущенные в рамках какого-либо имущественного пула, исключаются из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо на основании решения Правления о прекращении данного имущественного пула *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 18 июля 2022 года)*.

32. Ценные бумаги какого-либо наименования исключаются из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо без ЦК при возникновении любого из следующих оснований:

1) в отношении ценных бумаг данного наименования перестали соблюдаться применимые условия из числа установленных пунктами 13–14-1 и 25 настоящей Спецификации *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)*;

2) ценные бумаги данного наименования исключены из официального списка Биржи.

33. Исключение ценных бумаг из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК по основанию, указанному в подпункте 1) пункта 31 настоящей Спецификации, осуществляется на основании уведомления клиринговой организации посредством электронной почты об исключении ценных бумаг из Списка Т+ либо служебной записки от подразделения мониторинга, в следующем порядке *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*:

1) подразделение торгов посредством установления необходимых настроек торгово-клиринговой системы исключает ценные бумаги соответствующих наименований из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК;

2) в день исключения ценных бумаг каких-либо наименований из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо с ЦК подразделение торгов направляет по электронной почте в подразделение информации и статистики сведения о таких ценных бумагах.

34. Исключение ценных бумаг из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо по основанию, указанному в подпункте 1) пункта 32 настоящей Спецификации, осуществляется в следующем порядке:

1) подразделение мониторинга не реже одного раза в неделю осуществляет проверку ценных бумаг всех наименований, разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо, на соответствие условиям, установленным пунктами 13–14-1 и 25 настоящей Спецификации, и при выявлении любого несоответствия составляет служебную записку со сведениями о таких ценных бумагах, согласовывает ее с членами Правления Биржи, курирующими подразделение мониторинга и подразделение торгов, и направляет в подразделение торгов *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)*;

2) подразделение торгов посредством установления необходимых настроек торгово-клиринговой системы исключает ценные бумаги соответствующих наименований из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо на основании служебной записки, указанной в подпункте 1) настоящего пункта, не позднее следующего рабочего дня после получения такой служебной записки;

3) в день исключения ценных бумаг каких-либо наименований из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо подразделение торгов направляет по электронной почте в подразделение информации и статистики сведения о таких ценных бумагах.

35. Исключение ценных бумаг из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо по основаниям, указанным в подпункте 2) пункта 31 и подпункте 2) пункта 32 настоящей Спецификации, осуществляется в следующем порядке:

1) подразделение торгов ежедневно проверяет ценные бумаги всех наименований, разрешенные к использованию в качестве предметов операций репо, на выполнение условий, установленных подпунктом 2) пункта 31 и подпунктом 2) пункта 32 настоящей Спецификации, и при выявлении такого выполнения посредством установления необходимых настроек торгово-клиринговой системы исключает ценные бумаги соответствующих наименований из числа разрешенных к такому использованию;

2) по исключению ценных бумаг каких-либо наименований из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо подразделение торгов направляет по электронной почте в подразделение информации и статистики сведения о ценных бумагах данных наименований *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 15 августа 2023 года)*;

3) по получению сведений в соответствии с подпунктом 2) настоящего пункта подразделение информации и статистики выполняет необходимые последующие действия.

36. Исключение ценных бумаг какого-либо наименования из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо по основаниям, указанным в пунктах 31 и 32 настоящей Спецификации, не затрагивает уже открытые операции репо с ценными бумагами данного наименования и не освобождает участников этих операций репо от исполнения сделок закрытия, относящихся к этим операциям репо.

37. Ценные бумаги, исключенные из числа разрешенных к использованию в качестве предметов операций репо, могут быть повторно разрешены к такому использованию в порядке и на условиях, установленных настоящей Спецификацией.

Глава 7. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

38. Ответственность за своевременное внесение изменений и/или дополнений (актуализация) в настоящую Спецификацию возлагается на подразделение торгов.

39. Настоящая Спецификация подлежит актуализации по мере необходимости. Настоящая Спецификация подлежит пересмотру на необходимость в актуализации не реже одного раза каждые 36 месяцев, исчисляемых с даты введения в действие настоящей Спецификации, а в случае ее актуализации – со дня введения в действие последних изменений/дополнений *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 25 декабря 2024 года)*.

Председатель Правления Алдамберген А. Ө.