АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания

от 11 июня 2026 года № 66)

Введен в действие

с 01 июля 2026 года

Г Л О С С А Р И Й

основных условных обозначений

г. Алматы

2026

ЛИСТ ПОПРАВОК

1. **Дополнение № 1:**
   - утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 01 октября 2026 года № 123);
   - введено в действие с 06 октября 2026 года.

Настоящий Глоссарий разработан в соответствии с внутренним документом АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) "Правила осуществления торгов" и определяет основные условные обозначения с целью их унифицированного использования как во внутренних документах и деятельности Биржи, так и в деятельности, по мере необходимости, членов Биржи и иных ее клиентов.

Биржа также использует в своей деятельности иные понятия и термины, определяемые в соответствии с нормативными правовыми актами Республики Казахстан.

1. Для целей настоящего Глоссария под условным обозначением понимается отсутствующее в действующем законодательстве обозначение какого-либо объекта, явления или события, сокращенное для удобства написания, чтения, восприятия и понимания словесного названия данного объекта (явления, события) и имеющее ограниченное использование (например, для целей только одного документа или только группы схожих между собой документов).
2. Приведенные в настоящем Глоссарии основные условные обозначения используются как во внутренних документах Биржи, так и в ее служебной документации и переписке.
3. Основные условные обозначения, используемые во внутренних документах Биржи, предназначенных для пользования, прежде всего членами Биржи, но не имеющих определений в таких внутренних документах, определены настоящим Глоссарием.
4. В пункте 5 настоящего Глоссария приведен перечень основных условных обозначений, используемых Биржей в своей деятельности в качестве организатора торгов.
5. Биржа использует в своей деятельности нижеперечисленные основные условные обозначения, означающие следующее:

    1) **"акции объявленные"** (применительно к акциям, выпущенным в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств) – акции, выпуск которых зарегистрирован в соответствии с законодательством государства регистрации эмитента, выпустившего эти акции;

    2) **"акции размещенные"** (применительно к акциям, выпущенным в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств) – акции из числа объявленных, проданные на первичном рынке ценных бумаг;

    3) **"акция привилегированная"** (применительно к акциям, выпущенным в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств) – акция, которая в обычных обстоятельствах не предусматривает право держателя данной акции на участие в управлении выпустившим ее эмитентом, за исключением определенных законодательством такого государства случаев, но взамен предусматривает преимущественное право держателя данной акции перед держателями простых акций на получение дивиденда по данной акции в заранее определенном гарантированном размере и на получение части имущества этого эмитента при его ликвидации;

    4) **"акция простая"** (применительно к акциям, выпущенным в соответствии с законодательством иных, помимо Республики Казахстан, государств) – акция, которая предусматривает безусловное право держателя данной акции на участие в управлении выпустившим ее эмитентом;

    5) **"виновный участник операции репо"** – участник операции репо, осуществленной без участия центрального контрагента, не исполнивший свои обязательства по заключенной им сделке открытия или закрытия репо;

    6) **"виновный участник торгов"** – участник торгов, не исполнивший свои обязательства по заключенной таким участником торгов сделке;

    7) **"временная база"** – условие определения количества дней между какими-либо датами в целях расчета суммы вознаграждения по долговой ценной бумаге (облигации), выражаемое в виде соотношения "условная или фактическая продолжительность какого-либо периода в днях / условное или фактическое количество дней в году";

    8) **"выкуп финансового инструмента"** – приобретение финансового инструмента выпустившим его эмитентом либо брокером, действующим по поручению, за счет и в интересах этого эмитента;

9) **"государственное казначейское обязательство"** или **"казначейское обязательство"** – государственное казначейское обязательство Республики Казахстан: государственная эмиссионная ценная бумага, выпускаемая Министерством финансов Республики Казахстан от лица Правительства Республики Казахстан;

10) **"дата закрытия репо"** или **"дата закрытия"** (применительно к операции репо) – день, установленный участниками операции репо или торгово-клиринговой системой для совершения сделки закрытия;

11) **"дата открытия репо"** или **"дата открытия"** (применительно к операции репо) – день заключения сделки открытия репо;

12) **"держатель пая"** (применительно к иностранным паевым инвестиционным фондам) – лицо, являющее собственником пая;

13) **"долговая ценная бумага дисконтная"** или **"облигация дисконтная"** – долговая ценная бумага (облигация), размещаемая по цене ниже ее номинальной стоимости, вознаграждением по которой является дисконт, и удостоверяющая в соответствии с условиями выпуска право собственника данной ценной бумаги (облигации) на получение от ее эмитента номинальной стоимости данной ценной бумаги (облигации) по истечении установленного срока ее обращения;

14) **"долговая ценная бумага индексированная"** или **"облигация индексированная"** – долговая ценная бумага (облигация), номинальная стоимость которой и/или вознаграждение по которой согласно условиям выпуска подлежит (подлежат) изменению в соответствии с изменением какого-либо показателя (индексации по какому-либо показателю);

15) **"долговая ценная бумага купонная"** или **"облигация купонная"** – долговая ценная бумага (облигация), удостоверяющая в соответствии с условиями выпуска право собственника данной ценной бумаги (облигации) на получение от ее эмитента номинальной стоимости данной ценной бумаги (облигации) по истечении установленного срока ее обращения, а также на получение вознаграждения по ней в виде купона (купонов);

16) **"долговая ценная бумага с плавающим купоном"** или **"облигация с плавающим купоном"** – купонная индексированная долговая ценная бумага (облигация), ставка купона по которой согласно условиям выпуска подлежит изменению в течение срока обращения, первоначально устанавливается только на ограниченное количество купонных периодов и, соответственно, не известна в отношении остальных купонных периодов;

17) **"доразмещение ценных бумаг"** – размещение ценных бумаг какого-либо наименования, не предлагавшихся к размещению или не размещенных в ходе предыдущих итераций специализированных торгов по размещению ценных бумаг данного наименования;

18) **доступ к торгово-клиринговой системе** – доступ юридического лица в лице их пользователей к торгово-клиринговой системе с правом совершения в ней и/или с нею определенных действий;

19) **"доходность долговой ценной бумаги"** или **"доходность облигации"** – выражаемый в процентах годовых показатель ожидаемого дохода по долговой ценной бумаге (облигации) для ее приобретателя при погашении (истечении срока обращения) данной ценной бумаги (облигации), без учета возможности реинвестирования сумм, полученных в качестве вознаграждения по ней;

20) **"заинтересованные лица"** – участники торгов и иные лица, пользующиеся услугами Биржи или информацией, которую предоставляет или публикует Биржа;

21) **"заявка"** – заявка на заключение сделки, поданная каким-либо участником торгов в торгово-клиринговую систему Биржи; объявление какого-либо участника торгов о желании заключить сделку на условиях данного объявления или на условиях, при которых допускается подача данного объявления;

22) **"заявка аукциона закрытия"** – заявка, поданная участником торгов в период приема заявок и/или дополнительного периода приема заявок во время проведения торгов в режиме аукциона закрытия;

23) **"заявка встречная"**:

(по отношению к действующей заявке на продажу финансовых инструментов какого-либо наименования) – заявка на покупку финансовых инструментов данного наименования;

(по отношению к действующей заявке на покупку финансовых инструментов какого-либо наименования) – заявка на продажу финансовых инструментов данного наименования;

24) **"заявка действующая"** – заявка, принятая Биржей, не удовлетворенная в полном размере и не аннулированная участником торгов, подавшим данную заявку, или Биржей;

25) **"заявка лимитированная"** или **"заявка конкурентная"** – заявка, которая содержит указание на цену финансовых инструментов какого-либо наименования, желаемых к продаже или покупке;

26) **"заявка недействующая":**

заявка, не принятая Биржей; или

заявка, удовлетворенная в полном размере; или

заявка, принятая Биржей, не удовлетворенная в полном размере, но аннулированная участником торгов, подавшим данную заявку, или Биржей;

27) **"заявка неконкурентная"** – то же, что и "заявка рыночная";

28) **"заявка нелимитированная"** – то же, что и "заявка рыночная";

29) **"заявка прямая"** (при использовании метода заключения прямых сделок) – заявка, адресованная какому-либо участнику торгов и предназначенная для обозрения только данным участником торгов;

30) **"заявка рыночная"** – заявка, которая не содержит указание на цену финансовых инструментов какого-либо наименования, желаемых к продаже или покупке, и означающая, что участник торгов, который подал данную заявку, желает заключить сделки по любым ценам, по которым возможно удовлетворение данной заявки;

31) **"зарегистрировавшая биржа (биржа основного (первичного) членства)"** – биржа, другого, помимо Республики Казахстан, государства, членом которой является участник системы электронных торгов, и признанная Биржей в соответствии с соглашением об удаленном доступе;

32) **"размер заявки"** или **"количество заявки"** – объем заявки в единицах измерения финансового инструмента;

33) **"инвестор"** – физическое либо юридическое лицо, намеренное воспользоваться услугами члена Биржи по приобретению (продаже) ценных бумаг;

34) **"индексированная номинальная стоимость долговой ценной бумаги"** или **"индексированная номинальная стоимость облигации"** – номинальная стоимость индексированной долговой ценной бумаги (облигации), индексированная по какому-либо показателю;

35) **"иностранное юридическое лицо"** – юридическое лицо, не подпадающее под определение термина "юридическое лицо Республики Казахстан";

36) **"интернет-провайдер"** – организация, оказывающая услуги доступа к Интернету;

37) **"клиент спонсируемого доступа"** или **"SMA-клиент"** – лицо, заключившее договор с участником торгов на заключение последним сделок в торгово-клиринговой системе за счет и в интересах данного лица на основании его поручений;

38) **"итерация торгов"** или **"итерация"** (применительно к дискретным торгам) – самостоятельный этап дискретных торгов;

39) **"клиринг на гросс-основе"** – процесс определения подлежащих исполнению требований и обязательств по каждой заключенной участником торгов сделке в отдельности;

40) **"клиринговый центр"** – АО "Клиринговый центр KASE", осуществляющее клиринговую деятельность и деятельность расчетной организации по сделкам с финансовыми инструментами и выступающее стороной по сделкам, заключаемым на организованном рынке ценных бумаг, для каждого продавца и каждого покупателя финансового инструмента;

41) **"клиринговый участник"** – лицо, заключившее с клиринговым центром договор на клиринговое обслуживание;

42) **"код расчетов"** – код, определяющий способ обеспечения и срок осуществления расчетов;

43) **"код расчетов "T0"** – код расчетов, используемый при заключении сделок с центральным контрагентом, обязательства по которым подлежат исполнению на нетто-основе, определяющий, что при подаче заявки проводится процедура контроля полного обеспечения возникающих обязательств, днем осуществления расчетов по которым является дата заключения данных сделок;

44) **"код расчетов "Yn"** – код расчетов, используемый при заключении сделок с центральным контрагентом, обязательства по которым подлежат исполнению на нетто-основе, определяющий, что при подаче заявки проводится процедура контроля частичного обеспечения возникающих обязательств, расчеты по которым приходятся на дату, определяемую как T+n, где T – дата заключения сделки, а n – число расчетных рабочих дней;

45) **"код расчетов "Y0/Ycn"** – код расчетов, используемый при заключении сделок репо с ЦК, обязательства по которым подлежат исполнению на нетто-основе, определяющие, что при открытии репо проводится процедура контроля частичного обеспечения возникающих обязательств, датой исполнения сделки открытия репо является дата, определяемая как T0, а датой исполнения сделки закрытия репо является дата, определяемая как T+cn, где T – дата заключения сделки, а cn – число календарных дней между датами закрытия и открытия репо;

46) **"код расчетов "Z0"** – код расчетов, используемый при заключении сделок без центрального контрагента, обязательства по которым подлежат исполнению на гросс-основе, определяющий, что при подаче заявки проводится процедура контроля полного обеспечения возникающих обязательств, днем осуществления расчетов по которым является дата заключения данных сделок;

47) **"код расчетов "Z0/Zcn"** – код расчетов, используемый при заключении сделок без ЦК, обязательства по которым подлежат исполнению на гросс-основе, определяющий, что при подаче заявки и вводе отчета на исполнение проводится процедура контроля полного обеспечения, датой исполнения сделки открытия репо является дата, определяемая как T0, а датой исполнения сделки закрытия репо является дата, определяемая как T+cn, где T – дата заключения сделки, а cn – число календарных дней между датами открытия и закрытия операции репо;

48) **"код расчетов "B0"** – код расчетов, используемый при заключении сделок без центрального контрагента на проводимых Биржей торгах методом подписки, публичного предложения либо специализированных торгах по размещению, приобретению, выкупу, продаже финансовых инструментов, обязательства по которым подлежат исполнению на гросс-основе, определяющий, что процедура контроля обеспечения возникающих обязательств проводится при подаче отчета на исполнение, день осуществления расчетов совпадает с датой заключения сделок;

49) **"код расчетов "Bz"** – код расчетов, используемый при заключении сделок без центрального контрагента на проводимых Биржей торгах методом подписки, публичного предложения либо специализированных торгах по размещению, приобретению, выкупу, продаже финансовых инструментов, обязательства по которым подлежат исполнению на гросс-основе, определяющий, что процедура контроля обеспечения возникающих обязательств проводится при подаче отчета на исполнение, день осуществления расчетов отличается от даты заключения сделок

50) **"конфиденциальность информации"** или **"конфиденциальность"** – признак информации, наличие которого обусловливает защиту от раскрытия в ходе ее получения, хранения, обработки или передачи и предоставления доступа к такой информации только при наличии законного основания;

51) **"котировка индикативная"** – заявка, не накладывающая обязательство на подавшего ее участника торгов заключить сделку на условиях данной заявки;

52) **"котировка обязательная"** – заявка на покупку или продажу финансовых инструментов какого-либо наименования, поданная маркет-мейкером в рамках исполнения его обязанностей по финансовым инструментам данного наименования, и означающая безусловное согласие маркет-мейкера заключить сделку на условиях этой заявки;

53) **"котировка обязательная наилучшая"** – объявленная маркет-мейкером обязательная котировка, указанная в которой цена покупки (продажи) финансовых инструментов какого-либо наименования является наиболее выгодной для продавцов (покупателей) финансовых инструментов данного наименования относительно цен, которые указаны маркет-мейкером во всех остальных его действующих обязательных котировках на покупку (продажу) финансовых инструментов данного наименования;

54) **"твердая котировка"** – под твердой котировкой понимается котировка, накладывающая на объявившего ее участника торгов обязательство заключить сделку на основании данной котировки;

55) **"котировка прямая"** – то же, что и "котировка индикативная";

56) **"кросс-сделки"** – сделки, заключенные на основании заявок противоположной направленности в интересах одного и того же клиента участника торгов;

57) **"купонный период"** – период, за который выплачивается один купон по купонной долговой ценной бумаге (облигации);

58) **"лимит позиции"** – значение в деньгах или ценных бумагах, в пределах которого может быть открыта позиция;

59) **"логин"** – персональный идентификационный код, присваиваемый пользователю для его обозначения в торгово-клиринговой системе;

60) **"маклер Биржи"** или **"маклер"** (применительно к работникам Биржи) – работник Биржи, осуществляющий функции по организации и проведению торгов финансовыми инструментами и обладающий наивысшими полномочиями среди других работников Биржи, осуществляющих такие функции;

61) **"международная финансовая организация"** или **"МФО"** – организация, созданная на основе международного договора в сфере международных финансов;

62) **"метод дискретных торгов"** – торги, которые могут проводиться в несколько итераций с определением цен сделок по результатам каждой такой итерации;

63) **"метод закрытых торгов"** – торги, при которых удовлетворение или неудовлетворение заявки зависит от того, какой именно участник торгов ее подал, а сделки являются договорным;

64) **"метод открытых торгов"** – торги, при которых удовлетворение или неудовлетворение заявки при прочих равных условиях не зависит от того, какой именно участник торгов ее подал, и предположительно присутствует конкуренция между потенциально неограниченным количеством участников торгов;

65) **"метод нерегулярных торгов"** – торги, которые проводятся по инициативе отдельных лиц (по заявлениям лиц, имеющих право подавать такие заявления;

66) **"МФЦА"** – Международный финансовый центр "Астана";

67) **"наблюдатель"** (применительно к торгово-клиринговым системам Биржи) – физическое или юридическое лицо, имеющее право просмотра хода и результатов торгов в торгово-клиринговой системе Биржи;

68) **"наименование финансовых инструментов"** – закрытое множество финансовых инструментов одного и того же вида, объединенных одними и теми же условиями выпуска, размещения, обращения и погашения (если вид данных финансовых инструментов предусматривает их погашение), а также одними и теми же признаками и реквизитами;

69) **"нерабочий день по иностранным валютам"** – рабочий день Республики Казахстан, в который по каким-либо причинам банки – корреспонденты Биржи не осуществляют расчеты по соответствующим иностранным валютам и национальной валюте;

70) **"номинальная стоимость пая"** (применительно к иностранным паевым инвестиционным фондам) – денежное выражение пая при первоначальном размещении паев паевого инвестиционного фонда;

71) **"облигация обеспеченная"** – облигация, по которой исполнение обязательств эмитента полностью или частично обеспечено залогом имущества эмитента, гарантией банка и/или гарантией государства и/или гарантией национального института развития, являющегося

банком, уполномоченным на реализацию государственной поддержки индустриально-инновационной деятельности, и/или гарантией специального фонда развития предпринимательства, созданного по решению Правительства Республики Казахстан, и/или иного юридического лица, контрольные пакеты акций которых принадлежат национальному управляющему холдингу, и/или национального управляющего холдинга;

72) **"обращение на торговой площадке Биржи"** или **"обращение на торговой площадке"** (применительно к Бирже) – возможность использования финансовых инструментов какого-либо наименования в качестве предметов сделок, заключаемых на данной торговой площадке Биржи;

72-1) **"оператор системы торговли углеродными единицами"** – подведомственная организация по регулированию выбросов парниковых газов уполномоченного органа в области охраны окружающей среды *(данный подпункт включен решением Правления Биржи от 01 октября 2026 года)*;

73) **"операционный день Биржи"** – часть рабочего дня, в течение которого Биржей осуществляются процедуры по организации и администрированию торгов на фондовом рынке;

74) **"операция автоматического репо"** – операция репо, осуществляемая "автоматическим" способом (на торгах, проводимых методом непрерывного встречного аукциона);

75) **"операция валютного свопа"** – заключение участниками торгов договора, являющегося производным финансовым инструментом, в соответствии с которым стороны договариваются об исполнении обязательств по базовым активам в будущем на согласованных условиях, при этом одним из условий такого договора является то, что исполнение в рамках него обязательств с более поздним сроком осуществления расчетов наступает не ранее третьего рабочего дня со дня исполнения обязательств с более ранним сроком осуществления расчетов;

76) **"операция репо"** – совокупность двух одновременно заключаемых, различающихся по срокам исполнения и противоположных по направлению друг к другу сделок с ценными бумагами одного и того же наименования (предметом операции репо), сторонами которых являются два одних и тех же лица (участники операции репо): сделка открытия репо (сделка открытия) и сделка закрытия репо (сделка закрытия);

77) **"операция обратного репо"** (применительно к отдельному участнику операции репо) – операция репо, в которой ее участник выступает покупателем репо;

78) **"операция прямого репо"** – операция репо, осуществляемая "прямым" способом (на торгах, проводимых методом заключения прямых сделок);

79) "**операция с иностранной валютой (условно называемая "краткосрочный валютный своп")"** – совокупность двух сделок купли-продажи, одновременно заключаемых между двумя одними и теми же участниками биржевых торгов иностранными валютами и противоположных по направлению друг к другу, с одним и тем же количеством одной и той же иностранной валюты, которые различаются между собой сроками осуществления расчетов по ним при условии, что исполнение сделки с более поздним сроком осуществления расчетов наступает не позднее второго рабочего дня со дня исполнения сделки с более ранним сроком осуществления расчетов;

80) **"организация-наблюдатель"** (применительно к торгово-клиринговым системам Биржи) – юридическое лицо, имеющее право просмотра хода и результатов торгов в торгово-клиринговой системе;

81) "**организация торгов"** – осуществление Биржей функций организатора торгов, определяемых в соответствии с законом Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг" и внутренними документами Биржи;

82) **"ответственный участник операции репо"** – участник операции репо, осуществленной без участия центрального контрагента, со стороны которого сделка открытия или закрытия репо не была подтверждена пользователем системы контроля и обеспечения;

83) **"отчет на исполнение"** – отчет, поданный участником торгов либо маклером Биржи в торгово-клиринговую систему, свидетельствующий о готовности участника торгов исполнить обязательства, возникшие в результате ранее заключенных сделок;

84) **"первичный дилер"** – профессиональный участник рынка ценных бумаг, член Биржи по категории "фондовая", допущенный в установленном законодательством Республики Казахстан и внутренними документами Биржи порядке к участию в торгах, уполномоченный участвовать в размещении государственных казначейских обязательств на основании присвоенного ему статуса первичного дилера и заключенного с эмитентом казначейских обязательств договора по совершению операций с данными обязательствами;

85) **"первичное размещение"** – размещение объявленных эмиссионных ценных бумаг эмитентом (андеррайтером или эмиссионным консорциумом), за исключением дальнейшего размещения эмитентом ранее выкупленных им эмиссионных ценных бумаг на вторичном рынке ценных бумаг;

86) **"первый руководитель организации"** – руководитель исполнительного органа организации или лицо, единолично осуществляющее функции исполнительного органа организации;

87) **"период технического сбоя"** – промежуток времени от начала и до окончания технического сбоя;

88) **"платформа электронных услуг Биржи"** – специализированная электронная система и/или сервис, предназначенные для оказания Биржей услуг в электронном виде, включая прием, обработку, подписание, обмен и хранение документов;

89) **"позиция"** – сумма денег (денежная позиция) или количество ценных бумаг (позиция по ценным бумагам), учитываемые на торгово-клиринговых счетах участника торгов (и/или его клиентов) в торгово-клиринговой системе Биржи;

90) **"покупатель репо"** – участник операции репо, покупающий предмет операции репо при совершении сделки открытия и продающий его при совершении сделки закрытия;

91) **"полное покрытие"** – условие заключения сделок, при котором осуществляется проверка наличия полного обеспечения по возникающим в результате этого заключения обязательствам в тех финансовых инструментах, в которых они возникают до момента их исполнения;

92) **"пользователь"** (применительно к какой-либо информационной системе Биржи) – лицо, имеющее право доступа к информационной системе Биржи;

93) **"пользователь системы контроля и обеспечения"** или **"пользователь СКО"** –кастодиан, которому предоставлен доступ к системе контроля и обеспечения в целях обеспечения исполнения сделок, заключенных уполномоченным участником торгов от имени клиента такого кастодиана;

94) **"пользователь торгово-клиринговой системы"** – физическое лицо, имеющее право совершать действия в торгово-клиринговой системе Биржи от имени соответствующего юридического лица, имеющего право на подключение к торгово-клиринговой системе Биржи;

95) **"пострадавший участник операции репо"** – участник операции репо, осуществленной без участия центрального контрагента, заключенная которым сделка открытия или закрытия репо не была исполнена по причине неисполнения виновным участником операции репо своих обязательств по данной сделке;

96) **"предмет операции репо"** – ценные бумаги и/или иные финансовые инструменты, являющиеся аналогичными (одного выпуска) покупаемые и продаваемые в неизменном количестве при осуществлении операции репо;

97) **"программно-технический комплекс Биржи"** – торгово-клиринговые системы Биржи, информационные системы, телекоммуникационные средства, аппаратный комплекс, которые находятся в собственности или в пользовании Биржи и используются ей в целях осуществления торгов;

98) **"продавец репо"** – участник операции репо, продающий предмет операции репо при совершении сделки открытия и покупающий его при совершении сделки закрытия;

99) **"рабочий день"** – день, который является рабочим в Республике Казахстан;

100) **"размер заявки"** – объем заявки в натуральном выражении (в единицах измерения финансовых инструментов);

101) **"раздел KASE"** – субсчет лицевого счета клирингового участника фондового рынка (клиентский или собственный) в системе учета АО "Центральный депозитарий ценных бумаг" для учета на нем ценных бумаг, используемых для обеспечения и исполнения сделок с участием центрального контрагента на фондовом рынке, право списания ценных бумаг с которого может осуществляться только после положительной проверки на достаточность обеспечения со стороны центрального контрагента;

102) **"размер сделки"** – объем сделки в натуральном выражении (в единицах измерения финансовых инструментов);

103) **"распределение ценных бумаг между участниками торгов"** – определение продавцом предельных величин (цены и количества ценных бумаг) заявок таких участников, по которым данные заявки подлежат удовлетворению

104) **"расчетный код"** – клиринговый регистр, используемый на срочном рынке и предназначенный для учета информации об обеспечении участника торгов в деньгах и/или обязательств по сделкам, стороной по которым является данный участник торгов;

105) **"режим торгов"** – порядок организации и проведения торгов по определенной группе финансовых инструментов, включая условия заключения сделок, исполнения обязательств по ним, клиринга и расчетов;

106) **"режимы торгов без участия ЦК"** – режимы торгов и операций, в которых сделки (включая операции репо) заключаются (осуществляются) без участия центрального контрагента;

107) **"режимы торгов с участием ЦК"** – режимы торгов и операций, в которых сделки (включая операции репо) заключаются (осуществляются) с участием центрального контрагента;

108) **"режимы "Переводы обеспечения"** – режимы в торгово-клиринговой системе ASTS+, используемые в целях осуществления операций переводов обеспечения в деньгах или ценных бумагах или установления лимитов обеспечения в деньгах или ценных бумагах на торгово-клиринговые счета (сегрегация/агрегация финансовых инструментов);

109) **"режимы "Переводы на расчеты"** – режимы в торгово-клиринговой системе ASTS+, используемые в целях осуществления функций контроля целевого размещения активов и перевода исполнения требований и обязательств по сделкам, заключенным в режимах торгов с участием центрального контрагента, в интересах клиента пользователя системы контроля и обеспечения;

110) **"результативная торговая сессия"** – торговая сессия по финансовым инструментам какого-либо наименования или вида, в ходе которой была заключена хотя бы одна сделка с финансовыми инструментами данного наименования (вида);

111) **"режим удаленного доступа"** – способ работы с торгово-клиринговой системой, не требующий физического присутствия на Бирже пользователя торгово-клиринговой системы (физического лица, уполномоченного на совершение определенных действий в торгово-клиринговой системе);

112) **"рейтинг"** (в зависимости от контекста):

то же, что и "рейтинговая оценка"; или

процесс, целью которого является присвоение буквенного, числового, буквенно-числового или порядкового показателя, отображающего важность или значимость какого-либо объекта, явления или события;

113) **"рейтинговая оценка"** – буквенный, числовой, буквенно-числовой или порядковый показатель, отображающий важность или значимость какого-либо объекта, явления или события;

114) **"реестр принятых заявок"** – перечень заявок, которые приняты Биржей от участников торгов и включены в итоговый список заявок, передаваемых продавцу (покупателю);

115) **"реестр удовлетворенных заявок"** – перечень подлежащих удовлетворению заявок, полученный Биржей от продавца (покупателя);

116) **"сделка"** – сделка с финансовым инструментом, заключенная на торгах;

117) **"сделка без ЦК"** – сделка с финансовым инструментом, заключенная в режиме торгов без участия центрального контрагента;

118) **"сделка с ЦК"** – сделка с финансовым инструментом, заключенная в режиме торгов с участием центрального контрагента;

119) **"сделка, заключенная каким-либо методом проведения торгов"** или **"сделка, которая заключена каким-либо методом проведения торгов"** – сделка, которая заключена на торгах, проведенных данным методом проведения торгов;

120) **"сделка закрытия репо"** или **"сделка закрытия"** (применительно к операции репо) – вторая по очередности исполнения сделка из двух, составляющих в совокупности операцию репо; сделка купли-продажи ценных бумаг того же, что и в случае сделки открытия репо, наименования, предполагающая передачу денег в сумме данной сделки от второго из участников операции репо первому из них и возврат того же, что и в сделке открытия репо, количества ценных бумаг этого наименования первым из участников операции репо второму из них;

121) **"сделка открытия репо"** или **"сделка открытия"** (применительно к операции репо) – первая по очередности исполнения сделка из двух, составляющих в совокупности операцию репо; сделка купли-продажи ценных бумаг какого-либо наименования, предполагающая перевод денег в сумме данной сделки от одного из участников операции репо второму из них и передачу определенного количества ценных бумаг этого наименования вторым из участников операции репо первому из них;

122) **"сделка прямая"** – сделка, которая заключена на торгах, проведенных методом заключения прямых сделок;

123) **"система контроля и обеспечения"** – система контроля за целевым размещением активов и обеспечения исполнения сделок, входящая в состав торгово-клиринговой системы ASTS+, позволяющая:

- осуществлять управление обеспечением или определять лимиты обеспечения на торгово-клиринговые счета;
- подтверждать сделки без ЦК, заключенные уполномоченным участником торгов от имени клиента пользователя системы контроля и обеспечения;
- принимать/передавать на расчеты сделки, заключенные в интересах клиента пользователя системы контроля и обеспечения, в режимах торгов с участием центрального контрагента;

124) **"система электронных торгов"** – электронная торговая система, обеспечивающая ее участникам удаленный доступ к торговой системе Биржи на основании соответствующего соглашения об удаленном доступе к системе электронных торгов, заключенного между зарегистрировавшей биржей и Биржей;

125) **"система DMA"** – комплекс программно-технических средств члена Биржи, который взаимодействует с торговой системой Биржи и предназначен для заключения сделок в торговой системе Биржи на основе заявок, сформированных на основе клиентских заказов DMA-клиентов;

126) **"соглашение об удаленном доступе"** – соглашение об удаленном доступе к системе электронных торгов, заключенное между Биржей и зарегистрировавшей биржей, которое регулирует порядок взаимодействия сторон при предоставлении удаленного доступа участникам системы электронных торгов;

127) **"спрэд"** – разница между ценами, которые указаны в наилучших обязательных котировках одного и того же маркет-мейкера на покупку и продажу финансовых инструментов одного и того же наименования;

128) **"средневзвешенный курс доллара США"** – средневзвешенная цена всех сделок с долларом США, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой, расчеты по которой осуществляются на следующий рабочий день после дня торгов;

129) **"срок операции репо"** – измеряемый в днях промежуток времени между датами закрытия и открытия репо;

130) **"ставка операции репо"** – исчисляемая в процентах годовых количественная характеристика операции репо, указываемая участником торгов в заявке, используемая для расчета суммы сделки закрытия;

131) **"сумма заявки"** – объем заявки в денежном выражении;

132) **"сумма сделки"** – объем сделки в денежном выражении;

133) **"тайм-аут"** – промежуток времени в пределах торговой сессии (торгового дня), который предоставляется маркет-мейкеру для объявления новых обязательных котировок по финансовым инструментам какого-либо наименования и в течение которого маркет-мейкеру разрешается не исполнять свои обязанности по финансовым инструментам данного наименования;

134) **"терминал торговой системы"**, или **"терминал торгово-клиринговой системы"**, или **"терминал"** – клиентская часть торговой или торгово-клиринговой системы Биржи; персональный компьютер, на котором установлено программное обеспечение торговой или торгово-клиринговой системы Биржи, который подключен к торговой или торгово-клиринговой системе Биржи и предназначен для работы с торговой или торгово-клиринговой системой Биржи (для совершения действий в торгово-клиринговой системе Биржи);

135) **"торги"** – торги, проводимые на Бирже;

136) **"торги английские"** – торги, проводимые методом английских торгов, при котором заявки на покупку могут подаваться участниками торгов только в сторону увеличения цены продаваемого финансового инструмента;

137) **"торги анонимные"** – торги, при проведении которых любому участнику торгов (за исключениями, установленными законодательством Республики Казахстан и внутренними документами Биржи) не предоставляется информация о том, какими именно другими участниками торгов поданы заявки и какие именно другие участники торгов являются сторонами сделок, заключенных на основе заявки данного участника торгов;

138) **"торги голландские"** – торги, проводимые методом голландских торгов, при котором заявки на покупку могут подаваться участниками торгов только в сторону уменьшения цены продаваемого финансового инструмента;

139) **"торги дискретные"** – торги, которые могут проводиться в несколько этапов (итераций) с определением цен сделок по результатам каждого такого этапа;

140) **"торги открытые"** – торги, при проведении которых удовлетворение или неудовлетворение заявки при прочих равных условиях не зависит от того, какой именно участник торгов ее подал, и предположительно присутствует конкуренция между потенциально неограниченным количеством участников торгов (в отличие от торгов, проводимых методом заключения прямых сделок, при которых удовлетворение или неудовлетворение заявки зависит от того, какой именно участник торгов ее подал, а сделки являются сугубо договорными);

141) **"торги специализированные"** – торги, проводимые методом специализированных торгов; используется только по отношению к размещению, продаже, выкупу и приобретению финансового инструмента, допущенного к обращению на Бирже, и только при наличии единственного продавца (покупателя) размещаемого (продаваемого, выкупаемого, приобретаемого) финансового инструмента;

142) **"торговая информация"** – информация о ходе и/или результатах проводимых (проведенных) Биржей торгов финансовыми инструментами;

143) **"торговая система Биржи"**, или **"торговая система"**, или **"торгово-клиринговая система Биржи"**, или **"торгово-клиринговая система"** – комплекс материально-технических средств, внутренних документов Биржи и иных необходимых активов и процедур, с использованием которых заключаются сделки с эмиссионными ценными бумагами и иными финансовыми инструментами между участниками торгов;

144) **"торгово-клиринговая система ASTS+ (валютный рынок)"** – торгово-клиринговая система Биржи, предназначенная для участников торгов категории "валютная", в которой проводятся торги иностранными валютами;

145) **"торгово-клиринговая система SPECTRA"** – торгово-клиринговая система Биржи, предназначенная для участников торгов категории "деривативы", участвующих в торгах производными финансовыми инструментами;

146) **"торгово-клиринговая система ASTS+ (фондовый рынок)"** – торгово-клиринговая система Биржи, предназначенная для участников торгов категории "фондовая", в которой проводятся торги ценными бумагами;

147) **"торговый счет"** – счет участника торгов или пользователя системы контроля и обеспечения, используемый им для заключения сделок и/или осуществления функций контроля за целевым размещением активов и/или обеспечением исполнения сделок в торговой/торгово-клиринговой системе Биржи;

148) **"торгово-клиринговый счет"** – счет, присвоенный участнику торгов или пользователю системы контроля и обеспечения, представляющий собой совокупность торгового счета и совпадающего с ним по номеру клирингового счета, обеспечивающего исполнение, учет и контроль сделок и/или операций, осуществленных с использованием такого торгового счета в торговой/торгово-клиринговой системе Биржи;

149) **"удаленный доступ"** – вывод участником системы электронных торгов заявок на покупку и/или продажу финансовых инструментов в торгово-клиринговую систему Биржи в рамках соглашения об удаленном доступе;

150) **"удовлетворение заявки"** – заключение сделок на основе заявки в полном или частичном ее размере за счет действующих встречных заявок;

151) **"участник операции репо"** – лицо, которое является стороной в двух сделках, составляющих в совокупности операцию репо;

152) **"участник торгов"** – член Биржи, допущенный к участию в торгах и принимающий в них участие, а также обладающий статусом клирингового участника, присвоенным клиринговой организацией;

153) **"участник системы электронных торгов"** – иностранный член Биржи, который является юридическим лицом, учрежденным в соответствии с законодательством другого, помимо Республики Казахстан, государства, и членом зарегистрировавшей его биржи в соответствии с соглашением об удаленном доступе;

154) **"уполномоченный орган по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций" или "уполномоченный орган"** – Агентство Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка;

155) **"уполномоченный участник торгов"** – участник торгов, уполномоченный пользователем системы контроля и обеспечения заключать сделки от имени его клиента;

156) **"целостность информации"** – состояние информации, при котором отсутствует любое ее изменение, либо изменение осуществляется только преднамеренно лицами, имеющими соответствующее право;

157) **"цена выгодная"**:

(для продавца финансовых инструментов какого-либо наименования) – цена финансовых инструментов данного наименования, не меньшая относительно той цены, по которой он готов продать финансовые инструменты данного наименования;

(для покупателя финансовых инструментов какого-либо наименования) – цена финансовых инструментов данного наименования, не большая относительно той цены, по которой он готов купить финансовые инструменты данного наименования;

158) **"цена "грязная"** (применительно к долговой ценной бумаге (облигации)) – цена купонной долговой ценной бумаги (облигации), включающая в себя накопленное (начисленное, но не выплаченное) вознаграждение по ней;

159) **"цена закрытия операции репо"** или **"цена закрытия"** (применительно к операции репо) – цена предмета операции репо, по которой заключается сделка закрытия репо;

160) **"цена заявки"** – указанная в заявке цена продажи или покупки финансовых инструментов какого-либо наименования, желаемых к продаже или покупке;

161) **"цена заявленная"** – то же, что и "цена заявки";

162) **"цена открытия операции репо"** или **"цена открытия"** (применительно к операции репо) – цена предмета операции репо, по которой заключается сделка открытия репо;

163) **"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;

164) **"цена отсечения"**:

- при проведении дискретного аукциона – цена финансового инструмента, определяемая в ходе отдельной итерации, и по которой возможно заключение сделок с этим финансовым инструментом в максимально возможном суммарном размере;
- при проведении специализированных торгов – цена финансового инструмента, исходя из которой единственный продавец (покупатель) этого финансового инструмента отбирает (отсекает) встречные заявки для заключения сделок с этим финансовым инструментом (по единой цене или по ценам, являющимся более выгодными для единственного продавца (покупателя) этого финансового инструмента).

Цена отсечения может иметь как денежное, так и процентное выражение (например, в процентах к номинальной стоимости облигации); в последнем случае допустимым синонимом словосочетания "цена отсечения" является словосочетание "ставка отсечения";

165) **"цена сделки"** – цена финансовых инструментов какого-либо наименования, по которой была заключена сделка;

166) **"цена "чистая"** (применительно к долговой ценной бумаге (облигации) – цена купонной долговой ценной бумаги (облигации), не включающая в себя накопленное (начисленное, но не выплаченное) вознаграждение по ней;

167) **"ценные бумаги объявленные"** (применительно к иностранным ценным бумагам) – ценные бумаги, выпуск которых зарегистрирован в соответствии с применимым законодательством;

168) **"Центральный депозитарий"** – АО "Центральный депозитарий ценных бумаг";

169) **"центральный контрагент" или "ЦК"** – организация, осуществляющая клиринговую деятельность и деятельность расчетной организации по сделкам с финансовыми инструментами, и выступающая стороной по сделкам, заключаемым на организованном и неорганизованном рынках ценных бумаг для каждого продавца и каждого покупателя финансового инструмента;

170) **"частичное обеспечение"** – условие заключения сделок, при котором осуществляется контроль достаточности обеспечения до момента исполнения по ним обязательств;

171) **"шлюз торгово-клиринговой системы"**, или **"шлюз"**, или **"шлюз торгово-клиринговой системы Биржи",** или **"шлюзовые системы"** – программно–технический комплекс торгово-клиринговой системы Биржи, посредством которого осуществляется взаимодействие информационных систем участников торгов с торгово-клиринговой системой в ходе проведения биржевых торгов;

172) **"электронная цифровая подпись"** – набор электронных цифровых символов, созданный средствами электронной цифровой подписи и подтверждающий достоверность электронного документа, его принадлежность и неизменность содержания;

173) **"Co-location (колокация)"** – услуга, состоящая в том, что провайдер сети удаленного доступа размещает оборудование клиента Биржи на своей территории в дата-центре, подключает его к электричеству, обеспечивает обслуживание и подключение к каналам связи с высокой пропускной способностью;

174) **"DMA-клиент"** – клиент члена Биржи, намеренный использовать или использующий DMA-систему для заключения членом Биржи от своего имени сделок в торгово-клиринговой системе Биржи по поручению и/или за счет и/или в интересах данного клиента.

6. Прочие понятия, используемые во внутренних документах Биржи, идентичны понятиям, определенным другими внутренними документами Биржи.

7. Настоящий Глоссарий подлежит опубликованию на интернет-ресурсе Биржи.

8. Ответственность за своевременное внесение в настоящий Глоссарий изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на подразделение Биржи, обеспечивающее деятельность торгов.

9. Настоящий Глоссарий подлежит актуализации по мере необходимости.

   Настоящий Глоссарий подлежит пересмотру на необходимость актуализации не реже одного раза каждые три года, исчисляемых со дня введения в действие настоящего Глоссария, а в случае его актуализации – со дня введения в действие последних изменений/дополнений.

Председатель Правления Мухамеджанов А. Н.