

Бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану ережесін бекіту туралы

Күші жойған

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау жөніндегі агенттігі Басқармасының 2005 жылғы 26 наурыздағы N 110 Қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2005 жылғы 5 мамырда тіркелді. Тіркеу N 3615. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының 2008 жылғы 28 қарашадағы N 196 Қаулысымен.

Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының 2008.11.28 N 196 Қаулысымен.

Бағалы қағаздар нарығы жұмысының айқындылығы мен тиімділігінің дәрежесін арттыру, инвесторлардың құқықтары мен мүдделерін қорғау мақсатында, сондай-ақ "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 56-бабына сәйкес, Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігінің (бұдан әрі - Агенттік) Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Қоса беріліп отырған Бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану ережесі бекітілсін.

2. Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының "Бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану ережесін бекіту туралы" 2004 жылғы 15 наурыздағы N 80 қаулысының (Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерін мемлекеттік тіркеу Тізілімінде N 2799 тіркелген) күші жойылды деп танылсын.

3. Осы қаулы Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелген күннен бастап он төрт күн өткеннен кейін қолданысқа е н е д і .

4. Бағалы қағаздар рыногының субъектілерін және жинақтаушы зейнетақы қорларын қадағалау департаменті (Тоқобаев Н.Т.):

1) Заң департаментімен (Байсынов М.Б.) бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуден өткізу ш а р а л а р ы н қ о л ғ а а л с ы н ;

2) осы қаулы Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелген күннен бастап он күндік мерзімде оны Агенттіктің

мүдделі бөлімшелеріне, сауда-саттық ұйымдастырушыға, бағалы қағаздар нарығында брокерлік-дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдарға, "Қазақстан қаржыгерлерінің қауымдастығы" Заңды тұлғалар бірлестігіне жіберсін.

5. Халықаралық қатынастар және жұртшылықпен байланыс бөлімі (Пернебаев Т.Ш.) осы қаулыны Қазақстан Республикасының бұқаралық ақпарат құралдарында жариялауды қамтамасыз етсін.

6. Осы қаулының орындалуын бақылау Агенттік Төрағасының орынбасары Е.Л.Бахмутоваға жүктелсін.

Төраға

Қ а з а қ с т а н Р е с п у б л и к а с ы
Қ а р ж ы н а р ы ғ ы н ж әне қ а р ж ы
ұ й ы м д а р ы н р е т т е у м е н қ а д а ғ а л а у
а г е н т т і г і Б а с қ а р м а с ы н ы ң
2 0 0 5 ж ы л ғ ы 2 6 н а у р ы з д а ғ ы
N 110 қаулысымен бекітілген

Бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану ережесі

Осы Ереже "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 56-бабының 3-тармағында көзделген бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану тәртібін а й қ ы н д а й д ы .

Ескерту: Кіріспеге өзгерту енгізілді - ҚР Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының 2005 жылғы 27 тамыздағы N 312 қаулысымен .

1. Мәміле тараптары арасында алдын ала келісілген баға бойынша жасалатын , бағалы қағаздар нарығында мұндай мәмілені жасағанға дейін қалыптасқан осы бағалы қағаздарға бағалардан елеулі ерекшеленетін мәміле сауда-саттықты ұйымдастырушы тікелей мәмілелерді жасау әдісімен өткізген сауда-саттықтарда жасалған мәміле деп танылады, егер:

мәмілені акциялармен жасаған кезде акциялармен осы мәміле бағасының осы Ереженің 3-тармағына сәйкес есептелген осы акциялардың орташа алғандағы нарықтық бағасының ауытқуы отыз және одан астам проценттік құрайды;

облигациялармен мәмілені жасаған кезде (оның ішіне мемлекеттік эмиссиялық бағалы қағаздармен) осы облигациялар кірістілігінің осы Ереженің 4-тармағына сәйкес есептелген өтеуге осы облигациялардың орташа алғандағы нарықтық кірістілігінің осы мәміленің бағасына сәйкес өтеуге ауытқуы үш және одан астам проценттік тармақты құрайды.

2. Шамамен бірдей бағамен және жасалу уақытымен қарсы бағыттылығы бар мынадай мәмілелер бағаны манипуляциялау мақсатында жасалмаған болып табылады:

1) сауда-саттықты ұйымдастырушының мұндай операцияларға арналған сауда жүйесі секторында жүзеге асырылатын сол бір репо операциясына жататын репоны ашу және жабу мәмілелері;

2) бірдей көлемдегі және сол бағалы қағаздармен жасалған екі мәміле, олардың екіншісі осы мәмілелердің біріншісін жасаған кезде жіберілген техникалық қатені түзету мақсатында жасалған болса;

3) сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда жүйесінде бағалы қағаздар бойынша міндетті баға белгілеуін қолдау мақсатында маркет-мейкермен жасалған мәмілелер;

4) мәміле жасалған күнге дейінгі соңғы отыз күн ішінде, бірақ осы кезеңнің кемінде он күн ішінде осы атаудағы бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушының кемінде он мүшесі тараптары болып табылатын, жиынтық көлемі елу миллион теңгеден кем емес кем дегенде жиырма мәміле жасалу шартымен сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда жүйесінде бағалы қағаздармен ашық сауда әдісімен жасалған мәмілелер.

Ескерту. 2-тармақ жаңа редакцияда жазылды - ҚР Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау Агенттігі Басқармасының 2008.05.26 N 78 (қолданысқа енгізілу тәртібін 2-тармақтан қараныз) Қаулысымен .

3. Акцияның орташа алғандағы нарықтық бағасы сауда-саттықты ұйымдастырушы соңғы толық өткен отыз күнтізбелік күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда жасалған акциялармен (ақшалай) мәмілелердің жиынтық көлемінің мұндай мәмілелердің жиынтық мөлшеріне бағалы қағаздармен) ара-қатынасы ретінде есептеледі (осы тармақтың екінші абзацында белгіленген ерекшеліктерді ескере отырып).

Егер көрсетілген кезең ішінде акциялармен жасалған мәмілелер саны бестен кем болған жағдайда, осы акциялардың орташа алғандағы нарықтық бағасы сауда-саттықты ұйымдастырушы соңғы толық өткен бір жүз сексен күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда жасалған осы акциялармен (ақшалай) соңғы бес мәміленің жиынтық көлемінің мұндай соңғы бес (бағалы қағаздармен) мәміленің жиынтық мөлшеріне ара-қатынасы ретінде есептеледі.

4. Өтеуге арналған облигациялардың орташа алғандағы нарықтық кірістілігі мына формула бойынша есептеледі:

$$E = \left[\sum_{i=1}^n \frac{X_i}{(1+r)^i} + \frac{V_n}{(1+r)^n} \right]$$

$$I = \frac{E \cdot V_n}{n}, \text{ мұнда}$$

$E \cdot V_n$

$I, \%$ - өтеуге арналған облигациялардың орташа алғандағы нарықтық кірістілігі, жылдық процентпен;

i - осы облигациялармен мәміле бағасына сәйкес өтеуге арналған облигациялардың кірістілігі, жылдық процентпен;

V - облигациялармен мәмілелер саны, ақшалай;

n - сауда-саттықты ұйымдастырушы соңғы толық өткен отыз күнтізбелік күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда жасалған облигациялармен мәмілелер саны (көрсетілген кезең ішінде облигациялармен жасалған мәмілелер саны бестен аз болған жағдайда, n сауда-саттықты ұйымдастырушы соңғы толық өткен бір жүз сексен күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда жасалған облигациялармен мәмілелер саны бес және одан астам құраса).

5. Уәкілетті орган бағалы қағаздармен бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған ретінде мәмілелерді:

сауда-саттықты ұйымдастырушының және бағалы қағаздар нарығының кәсіби қатысушыларының есептеріндегі;

бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің, мемлекеттік органдардың және өзге жеке және заңды тұлғалардың хаттарындағы (өтініштеріндегі, шағымдарындағы, х а б а р л а с у л а р ы н д а ғ ы) ;

бұқаралық ақпарат құралдарының жарияланымдардағы ақпарат негізінде анықтайды.

6. Бағаны манипуляциялау фактілерін растау мақсатында уәкілетті орган бағалы қағаздар нарығының субъектілерінен қажетті ақпарат беруді сұрата алады және қажет болғанда бағалы қағаздар нарығының субъектілеріне инспекциялық тексеруді жүзеге асырады.

7. Мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалды деп тану қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалауды жүзеге асыратын мемлекеттік уәкілетті органның (бұдан әрі - уәкілетті орган) бірінші басшысының немесе оның орынбасарының шешімімен ресімделеді.

8. Уәкілетті орган бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп танылған бағалы қағаздармен мәміле тараптарын осы Ереженің 7-тармағында көрсетілген шешім ресімделген күннен бастап он жұмыс күні ішінде мұндай тану туралы жазбаша хабардар етеді.

9. Реттеу тәртібі осы Ережеде айқындалмаған мәселелер Қазақстан Республикасының заңдарына сәйкес шешіледі.

© 2012. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің «Қазақстан Республикасының Заңнама және құқықтық ақпарат институты» ШЖҚ РМК