

Ұйымдастырылған бағалы қағаздар рыногында жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасы директорлар кеңесінің бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану мәселесі жөніндегі комитетін құру және оның жұмыс істеу ережесін, сондай-ақ оның сандық құрамын бекіту туралы

Күшін жойған

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқарамасының 2008 жылғы 28 қарашадағы N 196 Қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2009 жылғы 8 қаңтарда Нормативтік құқықтық кесімдерді мемлекеттік тіркеудің тізіліміне N 5476 болып енгізілді. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқарамасының 2014 жылғы 23 сәуірдегі № 70 қаулысымен

Ескерту. Күші жойылды - ҚР Ұлттық Банкі Басқарамасының 23.04.2014 № 70 қаулысымен (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі).

Бағалы қағаздар рыногының жұмыс істеуінің айқындылығы мен тиімділігінің дәрежесін арттыру, инвесторлардың құқықтары мен мүдделерін қорғау мақсатында, сондай-ақ, "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының 2003 жылғы 2 маусымдағы Заңының 56-бабына сәйкес Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігінің (бұдан әрі – Агенттік) Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ** :

1. Қоса берілген Ұйымдастырылған бағалы қағаздар рыногында жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасы директорлар кеңесінің бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану мәселесі жөніндегі комитетін құру және оның жұмыс істеу ережесі, сондай-ақ, оның сандық құрамы бекітілсін.

2. Мыналардың күші жойылды деп танылсын:

1) Агенттік Басқармасының "Бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану ережесін бекіту туралы" 2005 жылғы 26 наурыздағы N 110 қаулысы (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде N 3615 тіркелген);

2) Агенттік Басқармасының "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" 2005 жылғы 26 наурыздағы N 110 қаулысына толықтыру енгізу туралы" 2005 жылғы 27 тамыздағы N 312 қаулысы (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде N 3844 тіркелген) ;

3) Агенттік Басқармасының "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" 2005 жылғы 26 наурыздағы N 110 қаулысына өзгеріс енгізу туралы" 2008 жылғы 26 мамырдағы N 78 қаулысы (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде N 5259 тіркелген, 2008 жылғы 15 қыркүйекте Қазақстан Республикасының Орталық атқарушы және өзге де орталық мемлекеттік органдарының актілер жинағының N 9, 2008 жылғы 1 тамызда "Заң газеті" газетінде N 116 (1342) санында жарияланған).

3. Осы қаулы, ол бірінші рет ресми жарияланғаннан кейін қолданысқа е н г і з і л е д і .

4. "Қазақстан қор биржасы" АҚ осы қаулы мемлекеттік тіркелген күннен бастап, он жұмыс күн ішінде өзінің ұйымдық құрылымын және ішкі құжаттарын осы қаулының талаптарына сәйкес келтірсін.

5. Бағалы қағаздар нарығының субъектілерін және жинақтаушы зейнетақы қорларын қадағалау департаменті (М.Ж. Хаджиева):

1) Заң департаментімен (Н.В. Сәрсенова) 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 тіркеуден өткен күннен бастап он күндік мерзімде оны Агенттіктің мүдделі бөлімшелеріне, сауда-саттықты ұйымдастырушыларға және "Қазақстан қаржыгерлерінің қауымдастығы" заңды тұлғалар бірлестігіне мәлімет үшін ж і б е р с і н .

6. Агенттіктің Төрайым қызметі (А.А. Кенже) осы қаулыны Қазақстан Республикасының бұқаралық ақпарат құралдарында жариялау шараларын қолға а л с ы н .

7. Осы қаулының орындалуын бақылау Агенттік Төрайымының орынбасары А.Ө. Алдамбергенге жүктелсін.

Төрайым

Е. Бахмутова

Қазақстан
нарығын
реттеу

және
мен

Республикасы
қаржы
қадағалау

Қаржы
ұйымдарын
агенттігі

Б а с қ а р м а с ы н ы ң
2 0 0 8 ж ы л ғ ы 2 8 қ а р а ш а д а ғ ы
N 196 қаулысымен бекітілген

Ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілелерді бағаны манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасы директорлар кеңесінің бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану мәселесі жөніндегі комитетін құру және оның жұмыс істеу ережесі, сондай-ақ оның сандық құрамы

Осы Ереже "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының 2003 жылғы 2 маусымдағы Заңының (бұдан әрі – Бағалы қағаздар рыногы туралы Заң) 56-бабына сәйкес әзірленген және ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалған деп танудың тәртібін және талаптарын, сондай-ақ қор биржасы директорлар кеңесінің бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалған деп тану мәселесі жөніндегі комитетін құру және оның жұмыс істеу тәртібін, сондай-ақ оның сандық құрамын белгілейді.

1. Мәміле тараптары арасында алдын ала келісілген, осындай мәміле жасамас бұрын бағалы қағаздар нарығында қалыптасқан осы бағалы қағаздардың бағаларынан елеулі ерекшеленетін баға бойынша жасалатын мәміле деп, қор биржасымен өткізілген сауда-саттықта тікелей мәміле жасасу әдісімен жасалған, не мәміленің тараптары ретінде сауда-саттықтың қатысушысы сол бір тұлға болып табылатын мәміле танылады, егер:

1) акциялармен мәміле жасаған кезде осы акциялармен жасалған мәміле бағасының осы акциялардың, осы Ереженің 3-тармағына сәйкес есептелген орташа алғандағы бағасынан ауытқуы отыз және одан астам пайызды құрайды;

2) облигациялармен (оның ішінде мемлекеттік эмиссиялық бағалы қағаздармен) мәміле жасаған кезде осы мәміленің бағасына сәйкес осы өтелетін облигациялар кірістілігінің, осы Ереженің 4-тармағына сәйкес есептелген, осы өтелетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігінен ауытқуы үш және одан астам пайыздық тармақты құрайды.

2. Бағалы қағаздар рыногы туралы Заңының 56-бабының 5-тармағының 1) тармақшасында көзделген талапқа сәйкес келетін мынадай мәмілелер манипуляциялау мақсатында жасалған болып табылмайды:

1) қор биржасының сауда жүйесінің мұндай операцияларға арналған секторында жүзеге асырылатын сол бір "репо" операциясына жататын "репоны" а ш у ж ә н е ж а б у м ә м і л е л е р і ;

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

Қатысушыларының бірі, қор биржасының ішкі құжаттарында белгіленген маркет-мейкердің міндеттерін атқару шегінде әрекет ететін, осы мәміленің мәні болып табылатын бағалы қағаздардың маркет-мейкері болып табылатын, мәміле жасасқан кездегі маркет-мейкердің іс-әрекеттері бағалы қағаздар нарығында манипуляциялау мақсатында мәміле жасау болып табылмайды.

3. Акциялардың орташа мөлшерленген нарықтық бағасы қор биржасы соңғы толық өткен жеті күнтізбелік күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда акциялармен (ақшалай) жасалған мәмілелердің жиынтық көлемінің мұндай мәмілелердің жиынтық мөлшеріне (бағалы қағаздармен) ара-қатынасы ретінде есептеледі (осы тармақтың екінші және үшінші абзацында белгіленген ерекшелікті ескере отырып).

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

Егер соңғы толық өткен алпыс күнтізбелік күн ішінде акциялармен жасалған мәмілелердің саны бестен кем болса, осы акциялардың орташа мөлшерленген бағасы е с е п т е л м е й д і .

4. Өтелетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігі мына формула бойынша есептеледі:

$$I = \frac{\sum_{i=1}^n [inxV_n]}{\sum V_n}$$

, мұнда

I - өтелетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігі, жылдық п а й ы з б е н ;

i - осы облигациялармен жасалған мәміле бағасына сәйкес өтелетін облигациялардың кірістілігі, жылдық пайызбен;

V - облигациялармен жасалған мәміленің көлемі, ақшалай;
n – қор биржасы соңғы толық өткен жеті күнтізбелік күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда облигациялармен жасалған мәмілелер саны.

Соңғы толық өткен жеті күнтізбелік күн ішінде облигациялармен жасалған мәмілелер саны бестен кем болған жағдайда, n, қор биржасы соңғы толық өткен алпыс күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда облигациялармен жасалған мәмілелер саны бес және одан астамын құрау шартымен, бес не одан көп болады.

Егер соңғы толық өткен алпыс күнтізбелік күн ішінде облигациялармен жасалған бестен кем болса, осы өтетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігі есептелмейді.

5. Бағалы қағаздар рыногы туралы Заңының 56-бабының 5-тармағында аталған талаптардың біреуіне сәйкес келетін мәмілелерден басқа бағалы қағаздар рыногында манипуляциялау мақсатында жасалған бағалы қағаздармен мәмілелерді анықтау үшін мынадай мәмілелер мониторингке және талдауға ж а т а д ы :

1) қор биржасының сауда жүйесінде немесе бағалы қағаздарды сатушы және сатып алушы дербес немесе қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау жөніндегі мемлекеттік уәкілетті органының (бұдан әрі – уәкілетті орган) брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға лицензиясы бар ұйымының мәміле жасау жөніндегі бұйрықтарын тапсыру арқылы әрекет ететін сол бір тұлға болатын ұйымдастырылмаған нарықта жасалған мәміле;

2) жай, заңды салдарын туғызуға ниеті болмай жасалған мәміле не бірнеше мәміле (жалған мәмілелер);

3) басқа мәмілені жасыру мақсатында жасалған мәміле не бірнеше мәміле (б ү р к е м е мәмілелер).

6. Қор биржасының ішкі құжаттарында осы қор биржасының сауда жүйесінде жасалған мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалды деп тану бойынша Бағалы қағаздар рыногы туралы Заңының 56-бабының және осы Ереженің талаптарына қарама-қайшы келмейтін қосымша талаптары көзделуі мүмкін.

7. Жасалу параметрлері мен шарттары Бағалы қағаздар нарығында манипуляциялау мақсатында жасалды деп болжамдауға негіздеме беретін бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді (бұдан әрі - күмәнді мәмілелер) анықтауды м ы н а л а р ж ү з е г е а с ы р а д ы :

1) қор биржасы мен бағалы қағаздар нарығының кәсіби қатысушыларының есептерінде, бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің, мемлекеттік органдардың және өзге жеке және заңды тұлғалардың хаттарында (өтініштерінде, шағымдарында) бұқаралық ақпарат құралдарындағы жарияланымдарда бар ақпараттың негізінде, сондай-ақ, бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің

қызметін тексеру қорытындысы бойынша уәкілетті орган;

2) қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесі.

Манипуляциялау фактіні растау не болмауын анықтау мақсатында уәкілетті орган бағалы қағаздар нарығының субъектілерінен қажетті ақпаратты ұсынуды сұратады не, қажет болған жағдайда, бағалы қағаздар нарығы субъектілердің тексеруін жүзеге асырады.

8. Қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесі күдікті мәмілелерді анықтаған жағдайда күдікті мәміле туралы есеп оны жасаған күні қор биржасы директорлар кеңесінің мәмілелерді манипуляциялау мақсатында жасалды деп тану мәселесі жөніндегі комитеттің (бұдан әрі – сараптама комитеті) қарауына тапсырылады.

9. Сараптама комитеті жеті адамнан құрылады және құрамында төраға мен алты мүшесі болады. Сараптама комитетінің төрағасы қор биржасының директорлар кеңесімен сараптама комитеті мүшелерінің қатарынан сайланады.

Сараптама комитетінің мүшелері:

- 1) уәкілетті органның екі өкілі;
- 2) бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастыру мәселелерін басшылық ететін қор биржасының атқарушы органының мүшесі;
- 3) қор биржасының директорлар кеңесінің екі мүшесі;
- 4) қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесінің басшысы;
- 5) "Қазақстан қаржыгерлерінің қауымдастығы" заңды тұлғалар бірлестігінің өкiлi .

Қор биржасы атқарушы органының басшысы және қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесінің басшысы сараптама комитетінің төрағасы болып сайлана алмайды.

Сараптама комитетінің құрамы қор биржасының директорлар кеңесінің шешімімен бекітіледі және уәкілетті органмен келісіледі.

10. Сараптама комитетінің отырыстары қажеттілігіне қарай өткізіледі.

Сараптама комитетінің отырысына қаралатын күдікті мәміленің тараптары болып табылатын ұйымдардың өкілдері, және (немесе) осы ұйымдар мәміле жасау жөніндегі бұйрықтарына сәйкес әрекет еткен олардың клиенттері шақырылуы мүмкін.

11. Сараптама комитетінің шешімдері оның мүшелерінің жалпы санының жай көпшілік дауысымен қабылданып, ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында

манипуляциялау мақсатында жасалған мәмілелер деп тану мәселелері жөніндегі сараптама комитетінің қорытындысы (бұдан әрі – сараптама комитетінің қорытындысы) түрінде ресімделеді.

Қаралатын күдікті мәміленің тараптары болып табылатын ұйымдарға, бағалы қағаздың немесе қаралатын күдікті мәміленің мәні болып табылатын бағалы қағаздың базалық активінің эмитентіне қатысты аффилирленген сараптама комитетінің мүшелері дауыс беруге қатыспайды.

12. Сараптама комитетінің қорытындысы, оған сараптама комитеті төрағасының қолы қойылып, қор биржасының директорлар кеңесінің жақын арада өтетін отырысына қарау үшін беріледі.

Сараптама комитеті қорытындысында бар, қор биржасының директорлар кеңесінің қарауына ұсынылатын ақпарат бағалы қағаздар нарығында қызметтік не коммерциялық құпия болып табылатын ақпаратқа жатпауы тиіс.

13. Қор биржасының директорлар кеңесімен бекітілген сараптама комитетінің қорытындысы уәкілетті органға күмәнді мәмілені анықтаған күннен бастап он бес жұмыс күннен кешіктірмей жіберіледі.

Қор биржасы сараптама комитетінің қорытындысын директорлар кеңесі бекіткеннен кейін уәкілетті органға жібереді.

14. Сараптама комитетінің мүшелері сараптама комитетінің жұмысына қатысу барысында алған ақпараттың, оның ішінде қызметтік, коммерциялық және заңмен қорғалатын өзге де құпия болып табылатын ақпараттың құпиялылығын қамтамасыз етеді және Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес жауапты болады.

15. Осы Ережемен реттелмеген мәселелері бойынша сараптама комитетінің жұмыс тәртібі қор биржасының ішкі құжаттарымен айқындалады.

16. Ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілені манипуляциялау мақсатында жасалды деп тану уәкілетті органмен қор биржасының директорлар кеңесінің сараптамалық қорытындысын (егер оның сауда жүйесінде ондай мәміле жасалған болса) қарау нәтижесі бойынша жүзеге асырылады және уәкілетті органның бірінші басшысының немесе оның орынбасарының шешімімен ресімделеді.

17. Уәкілетті орган бағалы қағаздар нарығында манипуляциялау мақсатында жасалған деп танылған бағалы қағаздармен жасалған мәміленің тараптарын осындай тану туралы осы Ереженің 16-тармағында көрсетілген шешім ресімделген күннен бастап он жұмыс күн ішінде жазбаша хабардар етеді.

18. Осы Ережемен реттелмеген мәселелер Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес шешілуге тиіс.

