

Ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасының сараптамалық комитетін құру және оның жұмыс істеу қағидаларын, сондай-ақ оның сандық құрамын бекіту туралы

Күшін жойған

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 23 сәуірдегі № 70 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2014 жылы 6 маусымда № 9488 тіркелді. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылғы 28 қаңтардағы № 13 қаулысымен

Ескерту. Қаулының күші жойылды - ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 28.01.2016 № 13 (01.10.2016 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Осы қаулының қосымшасына сәйкес қоса беріліп отырған Ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасының сараптамалық комитетін құру және оның жұмыс істеу қағидаларын, сондай-ақ оның сандық құрамы бекітілсін.

2. Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының "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" 2008 жылғы 28 қарашадағы № 196 қаулысының (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 5476 тіркелген, "Заң газеті" газетінде 2009 жылғы 18 ақпанда № 25 (1448) жарияланған) күші жойылды деп танылсын.

3. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі.

Ұлттық Банк

Төрағасы

Қ. Келімбетов

Ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасының сараптамалық комитетін құру және оның жұмыс істеу қағидалары, сондай-ақ оның сандық құрамы

Осы Ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану, қор биржасының сараптамалық комитетін құру және оның жұмыс істеу қағидалары, сондай-ақ оның сандық құрамы (бұдан әрі - Қағидалары), "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі – Бағалы қағаздар нарығы туралы заңы) сәйкес әзірленді және Қазақстан Республикасының ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп танудың тәртібін және талаптарын, қор биржасының сараптамалық комитетін құру және оның жұмыс істеу тәртібін, сондай-ақ оның сандық құрамын белгілейді.

1. Мәміле осындай мәміле жасамас бұрын ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында қалыптасқан осы бағалы қағаздардың бағаларынан елеулі ерекшеленетін баға бойынша жасалатын мәміле деп танылады, егер:

1) ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында акциялармен мәміле жасаған кезде осы акциялармен жасалған мәміле бағасының осы акциялардың, Қағидалардың 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, Қағидалардың 4-тармағына сәйкес есептелген, осы өтелетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігінен ауытқуы үш және одан астам пайыздық тармақты құрайды.

2. Орындалуы осы мәмілелердің тараптарындағы осындай бағалы қағаздардың маңызды өзгеруіне әкеп соқпаған бес жұмыс күн ішінде жасалған бағалы қағаздарды сатып алу - сатудың мынадай мәмілелері айла-шарғы жасау мақсатында жасалған болып табылмайды:

1) қор биржасының сауда жүйесінің мұндай операцияларға арналған 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 ұйымдастырылған нарықта осы мәмілелердің біріншісін жасаған кезде жіберілген техникалық қатені түзету мақсатында жасалған болса;

3) мына талаптарға немесе мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, қор биржасының сауда жүйесінде бағалы қағаздармен ашық сауда-саттық әдісімен жасалған мәмілелер:

мәміле жасалған күннің алдындағы соңғы отыз жұмыс күні ішінде, бірақ осы кезеңнің кемінде он жұмыс күні ішінде осы атаудағы бағалы қағаздармен қор биржасының кемінде он мүшесі тараптары болып табылатын, жиынтық көлемі елу миллион теңгеден кем емес, кемінде жиырма мәміле жасалған;

мәміле жасалған сәтінде осы бағалы қағаздар осы қор биржасында айналысқа жіберілген неғұрлым өтімді акциялардың бағасы бойынша қор биржасының ішкі құжаттарына сәйкес есептелетін қор биржасы индикаторының (индексінің) өкілдік тізіміне енгізілген.

3. Акциялардың орташа мөлшерленген нарықтық бағасы қор биржасы соңғы өткен бес жұмыс күні 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 болса, осы акциялардың орташа мөлшерленген нарықтық бағасы қор биржасы соңғы өткен күнтізбелік алпыс күні 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 өткен күнтізбелік алпыс күні ішінде акциялармен жасалған мәмілелердің саны бестен кем болса, осы акциялардың орташа мөлшерленген бағасы есептелмейді.

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

$$Y = \frac{\sum_{i=1}^n (Y_i \times V_i)}{\sum_{i=1}^n V_i},$$

мұнда

Y - өтелетін облигациялардың орташа мөлшерленген нарықтық кірістілігі, жылдық пайызбен;

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

V_i - облигациялармен жасалған i -лы мәміленің көлемі, ақшалай;

n - қор биржасы соңғы өткен бес жұмыс күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда облигациялармен жасалған мәмілелер саны.

Егер соңғы өткен бес жұмыс күн ішінде облигациялармен жасалған мәмілелер саны бестен кем болса, қор биржасы соңғы толық өткен күнтізбелік алпыс күн ішінде ашық сауда әдісімен өткізген сауда-саттықтарда облигациялармен жасалған мәмілелер саны бес және одан астамын құрау талабымен, n беске тең болады.

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

5. Бағалы қағаздар нарығы туралы заңының 56-бабының 5-тармағында аталған талаптардың біреуіне сәйкес келетін мәмілелерден басқа ұйымдастырылған немесе ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған бағалы қағаздармен мәмілелерді анықтау үшін мынадай мәмілелер мониторингке және талдауға жатады:

1) Қағидалардың 1-тармағында көзделген мәміле;

2) қор биржасының сауда жүйесінде немесе бағалы қағаздарды сатушы және сатып алушы дербес не қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау мен қадағалау жөніндегі уәкілетті мемлекеттік органның (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;

3) жай, заңды салдарын туғызу ниетісіз жасалған мәміле не бірнеше мәміле (жалған мәмілелер);

4) басқа мәмілені жасыру мақсатында жасалған мәміле не бірнеше мәміле (бүркеме мәмілелер).

6. Қор биржасының ішкі құжаттарында осы қор биржасының сауда жүйесінде жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалды деп тану бойынша Бағалы қағаздар нарығы туралы заңының 56-бабының және Қағидалардың талаптарына қарама-қайшы келмейтін қосымша талаптары көзделуі мүмкін.

7. Жасалу параметрлері мен талаптары осы мәмілелер ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарықтарында айла-шарғы жасау

мақсатында жасалған деп болжамдауға негіздеме беретін бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді (бұдан әрі - күмәнді мәмілелер) анықтауды мыналар жүзеге асырады:

1) қор биржасы мен бағалы қағаздар нарығының кәсіби қатысушыларының есептерінде, бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің, мемлекеттік органдардың және өзге жеке және заңды тұлғалардың хаттарында (арыздарында, шағымдарында, өтініштерінде) 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.

Айла-шарғы жасау фактісін болуы не болмауын растау мақсатында уәкілетті орган бағалы қағаздар нарығының субъектілерінен қажетті ақпаратты сұратады не, қажет болған жағдайда, бағалы қағаздар нарығы субъектілерін тексеруді жүзеге асырады және (немесе) күмәнді мәмілелер туралы ақпаратты қор биржасының бағалы қағаздармен жасалған мәмілелерді айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану мәселесі жөніндегі сараптама комитетінің (бұдан әрі - сараптама комитеті) қарауына жібереді.

8. Қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерді қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесі күмәнді мәмілелерді анықтаған жағдайда, күмәнді мәміле туралы есеп оны жасаған күні сараптама комитеті мүшелерінің қарауына тапсырылады.

9. Сараптама комитеті жеті адамнан құрылады және құрамында төраға мен алты мүшесі болады. Сараптама комитетінің төрағасын қор биржасының директорлар кеңесі сараптама комитеті мүшелерінің қатарынан сайлайды.

Мыналар:

уәкілетті органның екі өкілі;

қор биржасының бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастыру мәселелеріне жетекшілік ететін атқарушы органының мүшесі;

қор биржасының директорлар кеңесінің екі мүшесі;

қор биржасының сауда жүйесінде жасалатын мәмілелерін қадағалау жөніндегі қызметті жүзеге асыратын қор биржасының құрылымдық бөлімшесінің басшысы;

"Қазақстан қаржыгерлерінің қауымдастығы" заңды тұлғалар бірлестігінің өкілі Сараптама комитетінің мүшелері болып табылады.

Қор биржасының бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастыру мәселелеріне жетекшілік ететін атқарушы органының мүшесі 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 орган келіседі.

10. Сараптама комитетінің отырыстары қажеттілігіне қарай өткізіледі.

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

11. Сараптама комитетінің шешімі оның мүшелерінің жалпы санының жай көпшілік дауысымен қабылданады және 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 үлестес сараптама комитетінің мүшелері дауыс беруге қатыспайды.

12. Сараптама комитетінің қорытындысы оның күдікті мәмілелер бағалы қағаздар нарығында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп жорамалдауына қажетті және жеткілікті негіздердің болуына қатысты пікірінің көрінісі болып табылады.

Сараптама комитетінің қорытындысына сараптама комитеті төрағасының қолы қойылады және қор биржасы күдікті мәміле анықталған күннен бастап он бес жұмыс күнінен кешіктірмей оны уәкілетті органға жібереді.

Сараптама комитетінің қорытындысында бар ақпаратқа бағалы қағаздар нарығындағы коммерциялық құпиядан тұратын ақпарат кірмейді.

13. Сараптама комитетінің мүшелері сараптама комитетінің жұмысына қатысу барысында алған ақпараттың, оның ішінде коммерциялық және заңмен қорғалатын өзге де құпия ақпараттың конфиденциалдылығын қамтамасыз етеді және Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес жауапкершілік атқарады.

14. Осы Қағидалармен реттелмеген мәселелер бойынша сараптама комитетінің жұмыс тәртібі қор биржасының ішкі құжаттарымен айқындалады.

15. Ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілені бағалы қағаздар нарығында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану уәкілетті органмен сараптама комитетінің қорытындысын қарау нәтижелері бойынша жүзеге асырылады және уәкілетті органның бірінші басшысының немесе оның орынбасарының бұйрығымен ресімделеді.

16. Ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілені бағалы қағаздар нарығында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану уәкілетті органмен:

ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәміле туралы ақпарат сараптама комитетінің қарауына жіберілген жағдайда сараптама комитетінің пікірін қарау;

бағалы қағаздар нарығының кәсіби қатысушыларының есептеріндегі, бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің, мемлекеттік органдардың немесе жеке және заңды тұлғалардың хаттарындағы (арыздарындағы, шағымдарындағы, өтініштеріндегі), бұқаралық ақпарат құралдарының жарияланымдарындағы ақпаратты қарау қорытындылары бойынша, сондай-ақ бағалы қағаздар нарығы субъектілерінің қызметін тексеру нәтижелері бойынша жүзеге асырылады.

17. Ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар нарығында жасалған мәмілені бағалы қағаздар нарығында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп тану туралы шешім уәкілетті органның бірінші басшысының немесе оның орынбасарының бұйрығымен ресімделеді.

18. Уәкілетті орган бағалы қағаздар нарығында айла-шарғы жасау мақсатында жасалған деп танылған бағалы қағаздармен жасалған мәміленің тараптарын осындай тану туралы Қағидалардың 15 және 17-тармақтарында көрсетілген бұйрыққа қол қойылған күннен бастап он жұмыс күні ішінде жазбаша хабардар етеді.