

# "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

---

---

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің  
қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын  
реттеу мен бақылау Агенттігімен

2013 жылдың 06 наурызында

**К е л і с і л д і**

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің  
қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын  
реттеу мен бақылау Агенттігінің Төрағасы

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
Биржалық кеңес шешімімен

(2013 жылдың 31 қаңтарындағы  
отырысының № 02 хаттамасы)

**Б е к і т і л д і**

2013 жылдың 15 наурызынан бастап

**қолданысқа енгізілді**

К.Б. ҚОЖАХМЕТОВ

## Туынды қаржы құралдардың биржалық сауда-саттығының **ЕРЕЖЕЛЕРІ**

---

---

Алматы қ.

2013

## **ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ**

### **1. № 1 өзгерту:**

- Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкімен 2014 жылдың 24 сәуірінде келісілген;
- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Биржалық кеңесінің шешімімен (2014 жылдың 28 наурызындағы № 14 отырыс хаттамасы) бекітілді;
- 2014 жылдың 06 мамырынан бастап қолданысқа енгізілді.

### **2. № 2 өзгерту мен толықтыру:**

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен (2016 жылдың 28 наурызындағы № 11 отырыс хаттамасы) бекітілді;
- 2016 жылдың 29 наурызынан бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Ережелер Қазақстан Республикасының заңнамасына және Биржаның ішкі құжаттарына сәйкес әзірленіп, "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі - Биржа) өткізетін сауда-саттықта туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасау тәртібі мен шарттарын анықтайды.

## 1 тарау. ЖАЛПЫ ЕРЕЖЕЛЕР

### 1 бап. Қолданылатын ұғымдар

1. Осы Ережелердің мақсаттары үшін валюталық своптар туынды қаржы құралдары ретінде қарастырылмайды. Валюталық своп операциялары Биржаның "Шет ел валюталарымен биржалық сауда-саттық өткізу ережелеріне"<sup>1</sup> атты ішкі құжатына сәйкес жүзеге асырылады.
2. Осы Ережелерде қолданылған ұғымдар келесіні білдіреді:
  - 1) *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен алып тасталған);*
  - 2) *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен алып тасталған);*
  - 3) **деривативтер нарығы** – Биржада айналысқа (саудалауға) рұқсат етілген туынды қаржы құралдарынан тұратын қаржы нарығының секторы;
  - 4) **туынды қаржы құралдарының маманданымы** – туынды қаржы құралдарының шарттары мен параметрлерін анықтайтын, Биржаның ішкі құжаты;
  - 5) **трейдер** – Биржаның сауда-саттық жүйесіне қолданумен және Биржа мүшесінің атынан мәмілелер жасасуға және басқа да әрекеттер жасауға өкілденген, жеке тұлға *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген);*
  - 6) **Бира мүшесі** – Биржаның "деривативтер" санаты бойынша мүшесі *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген).*
2. Осы Ережелерде қолданылатын басқа да түсініктер, Қазақстан Республикасының заңнамаларында және Биржаның басқа да ішкі құжаттарында анықталған, түсініктерге ұқсас.

### 2 бап. Туынды қаржы құралдарымен биржалық мәміле жасасудың жалпы ережелері

1. Биржалық сауда-саттық мәні ретінде қолданылатын туынды қаржы құралдарының бірегей, стандартталған шарттары мен параметрлері бар.
2. Биржаның сауда-саттық жүйесінде туынды қаржы құралдарының екі секторы:
  - 1) валюталық туынды қаржы құралдары д.а., яғни негізгі активтер ретінде ұлттық және/немесе шетел валюталары қолданылатын, туынды қаржы құралдарының секторы;
  - 2) қордың туынды қаржы құралдары д.а., яғни негізгі активтер ретінде акциялар, облигациялар немесе қор нарығының индикаторлары қолданылатын туынды қаржы құралдарының секторы жұмыс істейді.

---

<sup>1</sup> Биржалық кеңестің шешімімен (1996 жылдың 01 қарашасындағы № 11 отырыс хаттамасы) бекітілген.

3. Туынды қаржы құралдарымен биржалық мәміле жасасу дегеніміз - Биржаның "Қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асыру ережелері"<sup>2</sup> атты ішкі құжатына және туынды қаржы құралдары бойынша құқықтары және/немесе міндеттемелерді оның ерекшеліктеріне сәйкес тараптардың сатып алуы болып табылады.
4. Биржалық сауда-саттық барысында Биржа мүшесі туынды қаржы құралдарын сатып алуға немесе сатуға өтінім беруі осы мүшенің туынды қаржы құралдарымен өтінімде көрсетілген шарттармен, немесе өтінімде көрсетілген шарттардан төмен емес, өтінімнің толық немесе жартылай көлемінде биржалық мәміле жасасауға келісім бергендігін білдіреді.
5. Биржа мүшесінің туынды қаржы құралдарын сатуға немесе сатып алуға берген өтінімдері туралы ақпарат, сондай-ақ осы Биржа мүшесінің туынды қаржы құралдарымен жасасқан мәмілелері туралы ақпарат құпия ақпараттар санатына жатады және таратуға және/немесе осы биржа мүшесінің келісімінсіз үшінші тұлғаға хабарлауына жатпайды.  
Уәкілетті органдарға ақпарат беру тәртібі, оның ішінде құпия санатындағы ақпараттар ұсыну Қазақстан Республикасының заңнамаларымен белгіленеді.

## 2 тарау. БИРЖАЛЫҚ САУДА-САТТЫҚҚА РҰҚСАТ АЛУ

### 3 бап.

#### Туынды қаржы құралдары

1. Биржалық сауда-саттық мәні ретінде қолданылатын туынды қаржы құралдарының стандартты шарттары мен параметрлері Биржа Басқармасы бекіткен олардың ерекшеліктерімен айқындалады.
2. Туынды қаржы құралдарының белгілі бір сериясы бойынша сауда-саттық Биржа Басқармасының шешімімен ашылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
3. Туынды қаржы құралдарының белгілі бір сериясы бойынша сауда-саттық ашу туралы шешім Биржа мүшелерінің назарына осы туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығының басталуына бес жұмыс күні қалғанға дейін жеткізіледі *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
4. Биржа өзінің мүшелерін туынды қаржы құралдарын айрықшалау әрекетіне кіріскені туралы, сондай-ақ туынды қаржы құралдарын айрықшалаудың өзгертулері мен толықтырулары күшіне енгені туралы, егер Биржа Басқармасының шешімімен басқа жағдайлар қарастырылмаған жағдайда он жұмыс күнінен кешіктірмей хабардар етеді.
5. Туынды қаржы құралдарының белгілі бір сериясы бойынша сауда-саттықты тоқтату күні, егер басқа жағдай Биржа Басқармасының шешімімен қарастырылмаған жағдайда, тиісті айрықшалаумен белгіленеді.

Биржа өзінің мүшелерін туынды қаржы құралдарының белгілі бір сериясы бойынша сауда-саттықты тоқтату туралы, егер Биржа Басқармасының шешімімен басқа жағдайлар қарастырылмаған жағдайда он жұмыс күнінен кешіктірмей хабардар етеді.

*(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*

---

<sup>2</sup> Биржалық кеңестің шешімімен (2015 жылдың 08 әуіріндегі № 7 отырыс хаттама) бекітілген *(осы сілтеме Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

**4 бап. Биржа мүшелері**

1. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына Биржа мүшелері қатысуға құқылы *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
2. Биржа мүшелігіне қабылдау тәртібі және Биржаның деривативтер нарығында мүшелік ету шарттары Биржаның ішкі құжаттарында анықталады.
3. Биржа мүшесі туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына, Биржаның "Клирингілік қатысушылар туралы қағида"<sup>3</sup> атты ішкі құжатына сәйкес деривативтер нарығындағы клирингілік қатысушы мәртебесін алғаннан кейін ғана қатыса алады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
4. Биржа мүшелері туынды қаржы құралдарымен өз атынан және өз есебінен, сондай-ақ өз клиенттерінің атынан және есебінен мәмілелер жасасуға құқылы.

Биржа мүшесі деривативтер нарығында өзінің клиентінің атынан мәміле жасау мақсатында Биржаға өзінің клиентін тіркеу туралы осы Ережелердің 1 қосымшасындағы нысанға сәйкес өтініш беруге міндетті.

5. Туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасау бойынша Биржа мүшелері мен олардың клиенттері арасындағы қарым-қатынастар олардың арасында жасалған келісімшарттармен реттеледі.
6. Биржа клиентін тіркеу туралы биржа мүшесі берген өтініш негізінде, ішкі құжаттарға сәйкес, осы клиентке клиенттің атынан жасалатын туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуді есепке алатын сауда шотының кодын береді.
7. Биржа мүшесі өзінің клиентін тіркеуді жою үшін Биржаға еркін түрде жазылған, осы клиентке берілген сауда кодын көрсете отырып, оны тікеуден алып тастау туралы өтініш береді.

Биржада клиентті тіркеуден алып тастау тек қана бұрын оның атына ашылған жайғасымдар толық жабылған жағдайда ғана орындалады.

**5 бап. Трейдерлер**

1. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына Биржа мүшелерінің атынан олар өкілдеген жеке тұлғалары - трейдерлер қатыса алады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
2. Трейдерлердің сауда-саттыққа қатысуға рұқсат алу шарттары биржаның ішкі құжаттарымен анықталады.
3. Туынды қаржы құралдарымен биржалық сауда-саттық операцияларын жасау барысында трейдерлердің жасаған кез-келген іс-әрекеті оларға Биржа мүшелері ұсынған әрекеттерге тең болып табылады.
4. Осы Ережелердің шарттарын трейдермен бұзуы фактілері анықталған жағдайда, Биржа осындай трейдерді туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына қатысудан шеттетуге құқылы *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

Осындай шеттетудің мерзімі мен шарттарын Биржа Басқармасы анықтайды.

---

<sup>3</sup> Биржалық кеңестің шешімімен (2015 жылдың 08 сәуіріндегі № 7 отырыс хаттамасы) бекітілген *(осы сілтеме Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен енгізілген)*.

Биржа Басқармасының трейдерді туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығытан шеттету туралы шешімі бойынша, Биржа мүшелері Биржалық кеңесте шағымдануы мүмкін *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

Шеттету туралы шешімге шағымдану оның қолданысын тоқтатпайды.

**6 бап. Сауда-саттыққа қатысуға рұқсат берілген, өзге тұлғалар**

1. Трейдерлер мен туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына қызмет етуші Биржаның қызметкерлерінен сондай-ақ Биржа Президенті мен Вице-президентінен басқа тұлғалар, Биржаның Президенті немесе туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығын өткізуге жетекшілік ететін Вице-президентінің рұқсатымен, биржалық сауда-саттыққа клирингтік байқаушы ретінде ғана қатыса алады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
2. Биржалық сауда-саттыққа қатысушы бірде бір тұлға сауда-саттық барысында сұрақтарды талқылауға, хабарландыру беруге немесе ескертулер жасауға, сондай-ақ осы сауда-саттыққа қатысты басқа да іс-әрекеттер жасауға құқығы жоқ.
3. Биржалық сауда-саттыққа қатысатын, трейдерлерден басқа, тұлғаларға туынды қаржы құралдарымен кез келген операцияларды жасауға тыйым салынады.
4. Биржалық сауда-саттыққа бақылаушы ретінде қатысушы тұлғаларға осы үдеріске тікелей немесе жанама түрде араласуға тыйым салынады.

**3 тарау. ТУЫНДЫ ҚАРЖЫ ҚҰРАЛДАРЫНЫҢ БИРЖАЛЫҚ  
САУДА-САТТЫҒЫН ӨТКІЗУ ТӘРТІБІ**

*(Осы тақырыптама Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*

**7 бап. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығын өткізу  
регламенті**

*(Осы тақырыптама Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*

1. Сауда-саттық регламенті (сауда-саттық өткізу уақыты мен орны және оларды өткізудің негізгі параметрлері) Биржаның ішкі құжаттарымен немесе биржа Басқармасының шешімімен анықталады.
2. Биржа өзінің мүшелерін Биржа Басқармасы белгілеген сауда-саттық өткізу орны мен уақытының өзгеруі туралы сауда-саттық басталғанға дейін сағат 18 -ден кешіктірмей, хабарлауы тиіс.

Сауда-саттық әдеттегі тәртіптемеде өткізу мүмкін болмаған жағдайда, осы тармақтың бірінші абзацымен белгіленген норма, Биржа Президенті немесе сауда-саттық өткізуге басшылық ететін Вице-президент сауда-саттық регламентін шұғыл өзгерткен жағдайға қатысты қолданылмайды *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

**8 бап. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығын өткізу әдісі**

*(Осы тақырыптама Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*

1. Туынды қаржы құралдарымен негізгі сауда-саттық өткізу бойынша биржалық сауда-саттық өткізудің негізгі әдісі ретінде үздіксіз қарсылама аукцион әдісі қолданылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
2. Туынды қаржы құралдарымен негізгі сауда-саттық өткізу сериялары үшін биржалық сауда-саттықты ашу бағасы ретінде алдыңғы биржалық сауда-саттық күніндегі мәліметтер бойынша есептелген теориялық бағасы<sup>4</sup> қолданылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
3. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығын өткізу мүмкін болмаған жағдайда Биржа басқармасының шешімі бойынша негізгі құралдар ретінде басқа да әдістер қолданылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.
4. Биржалық сауда-саттықты қандай да бір әдіспен өткізу тәртібі Биржаның ішкі құжаттарында сипатталады.

**9 бап. Шектелімтерді орындауды бақылау**

1. Деривативтер нарығында биржа бағаны өзгерту шектелімі және жайғасым ашу шектелімдерін белгілейді, оларды белгілеу тәртібі Биржаның ішкі құжаттарына сәйкес анықталады.
2. Туынды қаржы құралдар бағасын өзгертудің жоғарғы шектелімі осы туынды қаржы құралының есептесу бағасы мен оған белгіленген баға өзгерудің шектелімінің қосындысына тең болады.
3. Туынды қаржы құралдар бағасын өзгертудің төменгі шектелімі осы туынды қаржы құралының есептесу бағасы мен оған белгіленген баға өзгерудің шектелімінің айырмасына тең болады.
4. Егер өтінімде жарияланған баға туынды қаржы құралдарының жоғарғы немесе төменгі баға өзгеру шектелімінің шегінен асса, ондай өтініш автоматты түрде Биржаның сауда-саттық жүйесінен шығарылып тасталады.
5. Берілген өтінім жайғасым ашу шектеліміне сәйкес келмеген жағдайда, Биржаның сауда-саттық жүйесі мұндай өтінішті автоматты түрде шығарып тастайды.

**10 бап. Туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығын уақытша тоқтату**

*(Осы тақырыптама Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*

1. Биржа белгілі бір сериядағы туынды қаржы құралдарының сауда-саттығын келесі факторлардың комбинациясы туындаған кезде уақытша тоқтатады:
  - 1) қандай да бір өтінімнің бағасы осы сериядағы туында қаржы құралының баға ауытқуының шектелімінен 95 % жетті;

---

<sup>4</sup> Тиісті маманданымда көрсетілген, әдіспен анықталады *(осы сілтеменің нөмірі Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

- 2) аталмыш өтінімнің, берген сәттен бастап, үздіксіз отыз минут Биржаның сауда-саттық жүйесінде болуы;
- 2) осы сериядағы туынды қаржы құралдарының ашылған жайғасымдардың, көлемі осы сериядағы туынды қаржы құралдарының барлық сериялары бойынша ашылған жайғасымдардың жиынтық көлемінен кемінде 50 % құрайды.
2. Осы баптың 1 тармағына сәйкес сауда-саттықты тоқтату Биржаның сауда-саттық жүйесімен автоматты түрде жүзеге асырылады.
3. Биржа төменде көрсетілген жағдайларда барлық туынды қаржы құралдарының сауда-саттығын тоқтатуға құқылы:
  - 1) деривативтер нарығына айтарлықтай қауіп төндіріп тұрған бір немесе одан да көп Биржа мүшелерінің қабілетсіздігі анықталған жағдайда;
  - 2) туынды қаржы құралдарымен отыз тізбекті сауда-саттық күні ішінде сауда-саттық болмаған жағдайда;
  - 3) Биржаның сауда-саттық жүйесінде техникалық ақаулар болған жағдайда.
4. Осы баптың 3 тармағында қарастырылған жағдайлардың кез келгені орын алған жағдайда, туынды қаржы құралдарының сауда-саттығын уақытша тоқтату тек Биржа Басқармасының шешімімен жүзеге асырылуы мүмкін.

Биржа Басқармасының туынды қаржы құралдарының сауда-саттығын уақытша тоқтату туралы шешімінде осындай уақытша тоқтатудың себептері туралы мәліметтер болуы тиіс.
5. Туынды қаржы құралдарымен сауда-саттық тоқтатылған жағдайда мұндай құралдар бойынша барлық қолданыстағы өтінімдер сауда-саттықты тоқтату кезінде автоматты түрде алып тасталады.

*(Осы бап Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген).*

#### 4 тарау. ҚОРЫТЫНДЫ ҚАҒИДАЛАР

##### 11 бап. Маркет-мейкерлер

Деривативтер нарығындағы маркет-мейкер мәртебесін беру және айыру шарттары мен тәртібі, сондай-ақ оның қызметінің тәртібі Биржаның ішкі құжаттарымен анықталады.

##### 12 бап. Комиссиялық алым

1. Биржа мүшелері Биржаға туынды қаржы құралдарыме жасалған мәмілелер бойынша комиссиялық алымдар төлейді.
2. Биржаның комиссиялық алымдарының мөлшері, есептеу және төлеу тәртібі Биржаның ішкі құжаттарында анықталған.
3. Биржаның комиссиялық алымдарын төлеу бойынша деривативтер нарығы мүшелері және олардың клиенттері арасындағы қатынастар, олардың арасында жасалатын, жеке келісім-шарттармен реттеледі.



**13 бап. Даулар мен келіспеушіліктер**

Биржа мүшелері мен Биржа, сондай-ақ, Биржа мүшелері арасындағы туынды қаржы құралдарының биржалық сауда-саттығына байланысты даулар мен келіспеушіліктер Даулар мен жанжалдарды шешу Комиссиясымен немесе келіссөздер жүргізу арқылы шешуге жатады *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2016 жылдың 28 наурызындағы шешімімен өзгертілген)*.

Президент

Қ.Қ. Дамитов

Туында қаржы құралдардың  
биржалық сауда-  
саттығының ережелеріне  
**1 қосымша**

**Биржа мүшесінің клиентін тіркеу туралы**

**Ө Т І Н І Ш**

(фирмалық бланкіде)

(\_\_\_\_\_ ЖЫЛҒЫ (келісім-шарттың датасы және берілген нөмірі көрсетілуі тиіс) комиссия туралы келісім-шарты негізінде) біздің сауда-саттық және және есептесу қызметін көрсетуіміздегі және мынадай деректемелері бар клиентті тікеуді сұраймыз:

Клиенттің мәртебесі:	Заңды тұлға <input type="checkbox"/>	Жеке тұлға <input type="checkbox"/>
Заңды тұлға болған жағдайда, ұйымдастыру-құқықтық нысаны	Акционерлік қоғам <input type="checkbox"/>	Жауапкершілігі шектеулі серіктестік <input type="checkbox"/>
Заңды тұлға болған жағдайда, қызметінің түрі	Банктік қызмет <input type="checkbox"/>	Сақтандыру қызметі <input type="checkbox"/>
	Жинақтаушы зейнетақы қорының активтерін басқару <input type="checkbox"/>	Брокерлік-дилерлік қызмет <input type="checkbox"/>
	Өндірістік қызмет <input type="checkbox"/>	Өзге қызмет <input type="checkbox"/>
Резиденттігінің белгісі	Резидент <input type="checkbox"/>	Резидент емес <input type="checkbox"/>

Биржа мүшесінің атауы

(өтініш берушінің Мемлекеттік тіркеу (соңғы мемлекеттік қайта тіркеу) туралы куәлігіне сәйкес толық атауы)

Биржа мүшесінің өкілі (лауазымы)

(тегі, инициалдары)