

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Комитета Биржевого совета
ЗАО "Казахстанская фондовая биржа"
по валютному рынку

(протокол от 16 июня 2000 года № 3)

Введена в действие

с 03 июля 2000 года

Дополнение 4 к Правилам деятельности маркет–мейкеров

Приложение 3–2

к Правилам деятельности
маркет–мейкеров

С П Е Ц И Ф И К А Ц И Я

статуса маркет–мейкера рубля Российской Федерации

г. Алматы

2000

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Комитета Биржевого совета по валютному рынку ЗАО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 28 февраля 2002 года № 2);
- введены в действие с 02 мая 2002 года.

2. Решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 15 января 2004 года № 1 (з)) во всех внутренних документах биржи произведена замена слов "закрытое акционерное общество "Казахстанская фондовая биржа"" на "акционерное общество "Казахстанская фондовая биржа"" в соответствующих падежах и "ЗАО "Казахстанская фондовая биржа"" на "АО "Казахстанская фондовая биржа"".

3. Изменение и дополнение № 2:

- согласованы с Агентством Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций 03 июля 2009 года;
- утверждены решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 25 мая 2009 года № 15 (з));
- введены в действие с 07 июля 2009 года.

Статья 1. Статус маркет–мейкера

1. Статус маркет–мейкера рубля Российской Федерации (РФ) присваивается Правлением Биржи на основании подачи соответствующего заявления члена Биржи.

Статья 2. Требования, предъявляемые к маркет–мейкеру

2. Член Биржи, претендующий на присвоение статуса маркет–мейкера рубля РФ, должен иметь собственный капитал в размере не менее одного миллиона месячных расчетных показателей (*данный пункт изменен решением Биржевого совета от 28 февраля 2002 года*).

Статья 3. Обязанности маркет–мейкера

3. Маркет–мейкер рубля РФ обязан:
 - 3.1. В течение торгов рублем РФ поддерживать в торговой системе Биржи хотя бы одну твердую котировку на покупку и одну твердую котировку на продажу (именуемые далее "Обязательные котировки").
 - 3.2. Стремиться поддерживать между обязательными котировками минимально возможный спрэд. При этом спрэд по обязательным котировкам должен составлять:
 - 1) не более 0,009 тенге при условии, что минимальный объем обязательных котировок на покупку и на продажу по каждой котировке должен составлять не менее трех миллионов рублей РФ. При этом данный объем должен быть доступным к заключению сделки в любой момент времени торгов;
 - 2) не более 0,012 тенге при условии, что минимальный объем обязательных котировок на покупку и на продажу по каждой котировке должен составлять не менее шести миллионов РФ. При этом данный объем должен быть доступным к заключению сделки в любой момент времени торгов;
 - 3) не более 0,015 тенге при условии, что минимальный объем обязательных котировок на покупку и на продажу по каждой котировке должен составлять не менее девяти миллионов РФ. При этом данный объем должен быть доступным к заключению сделки в любой момент времени торгов.

Маркет–мейкер обязан поддерживать спрэд в размере не превышающем спрэд по котировкам, устанавливаемым им на межбанковском рынке.
 - 3.3. При снятии, частичном или полном удовлетворении обязательной котировки, в течение 1 минуты устанавливать новую обязательную котировку.

Статья 4. Права маркет–мейкера

4. Маркет–мейкер рубля РФ вправе:
 - 4.1. Не выполнять свои обязанности в течение всей утренней торговой сессии, а также с 12.30 до 14.00 алматинского времени в течение дополнительной сессии.
 - 4.2. Изменять цены ранее объявленных обязательных котировок при условии соблюдения установленного настоящей спецификацией спреда.
 - 4.3. Устанавливать обязательные котировки со спрэдом, который превышает требования, установленные пунктом 3.2 статьи 3 настоящей спецификации, в случае, если нетто-позиция маркет–

мейкера по сделкам с рублем РФ достигла тридцати миллионов рублей РФ.

- 4.4. Отказаться выставлять обязательные котировки, если объем нетто-позиции по сделкам с рублем РФ достиг 50 миллионов рублей.
- 4.5. В случае если на рынке складывается неординарная ситуация, объявить тайм-аут на срок не более пятнадцати минут. В течение тайм-аута маркет–мейкер имеет право снять все котировки и не выставлять новые котировки. Право на тайм-аут предоставляется только один раз в течение одного торгового дня. Для получения тайм-аута представитель маркет–мейкера обязан оповестить об этом маклера Биржи. Оповещение о взятом тайм-ауте осуществляется в произвольной форме и может быть произведено через терминал торговой системы, терминал REUTERS или по телефону.
- 4.6. Не платить комиссионный сбор по сделкам, заключаемым на биржевых торгах рублем РФ.

Статья 5. Преференции для маркет–мейкера

5. При наличии маркет–мейкера рубля РФ твердые котировки в торговой системе Биржи в торгах рублем РФ имеет право устанавливать только маркет–мейкер. Члены Биржи, не являющиеся маркет–мейкерами, при осуществлении сделок с рублем РФ могут заключать сделки только по котировкам, установленным маркет–мейкером *(данный абзац изменен решением Биржевого совета от 25 мая 2009 года)*.

При отсутствии маркет–мейкера рубля РФ члены Биржи в течение торгов рублем РФ имеют право выставлять твердые котировки и заключать сделки *(данный абзац включен решением Биржевого совета от 25 мая 2009 года)*.

Статья 6. Ответственность маркет–мейкера

6. В случае нарушения маркет–мейкером условий исполнения своих обязанностей, установленных настоящей спецификацией, три раза, на такого маркет–мейкера налагается штраф в пользу биржи в размере двадцати месячных расчетных показателей *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 28 февраля 2002 года)*.
7. Нарушение условий пункта 3.3 настоящей спецификации на срок пять минут и более, за исключением случаев, указанных в пунктах 4.1, 4.4 и 4.5, признается как отказ маркет–мейкера выставлять обязательные котировки. За отказ маркет–мейкера выставлять обязательные котировки такой маркет–мейкер лишается статуса маркет–мейкера и облагается штрафом в размере двухсот месячных расчетных показателей *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 28 февраля 2002 года)*.
8. Маркет–мейкер, нарушивший условия пункта 16 "Правил деятельности маркет–мейкеров", облагается штрафом в размере двухсот месячных расчетных показателей *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 28 февраля 2002 года)*.

Статья 7. Освобождение маркет–мейкера от выполнения своих обязанностей

9. Маркет–мейкер имеет право не исполнять свои обязанности, указанные в статье 3 настоящей спецификации, при получении соответствующего уведомления со стороны Биржи, в следующих случаях:
 - 9.1. Государственными органами Республики Казахстан вносятся изменения в законодательство Республики Казахстан, которые могут оказать значительное влияние на ситуацию на валютном рынке Республики Казахстан.

- 9.2. Происходят события внутри Республики Казахстан или за ее пределами, которые могут оказать значительное влияние на ситуацию на валютном рынке Республики Казахстан.
- 9.3. Происходят события на территории Российской Федерации, которые могут оказать значительное влияние на ситуацию на рынке российского рубля в Республике Казахстан.
10. Решение об освобождении маркет–мейкеров от исполнения обязанностей, указанных в статье 3 настоящей спецификации, в случаях, указанных в пункте 9 настоящей спецификации, до созыва Комитета Биржевого совета по валютному рынку принимается Правлением Биржи.

Президент

Карасаев Д.Б.

(Данное приложение изменено решением Биржевого совета от 15 января 2004 года)

АО "Казахстанская фондовая биржа"

З А Я В Л Е Н И Е

на присвоение статуса маркет–мейкера рубля Российской Федерации

Настоящим просим присвоить нам, [Полное наименование заявителя], статус маркет–мейкера рубля Российской Федерации (РФ) с [число месяц год].

Принимаем на себя обязанности маркет–мейкера, установленные статьей 3 приложения 3–2 "Правил деятельности маркет–мейкеров", утвержденных 16 июня 2000 года решением Комитета Биржевого совета по валютному рынку (протокол № 3).

Подтверждаем, что ознакомлены с ограничениями прав маркет–мейкеров, установленных в пункте 16 "Правил деятельности маркет–мейкеров" и в статье 6 приложения 3–2 указанных Правил.

Подпись представителя заявителя,
обладающего правом первой подписи

М.П.