

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н ы

решением Биржевого совета
ЗАО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол от 12 января 2001 года № 1)

Введены в действие

с 15 января 2001 года

ОБЯЗАННОСТИ И ПРАВА членов АО "Казахстанская фондовая биржа", имеющих статус маркет–мейкера облигаций международных финансовых организаций

*(Данный заголовок изменен решениями Биржевого совета от 15 января 2004 года
и от 14 апреля 2005 года)*

г. Алматы

2001

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Биржевого совета 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. Изменения и дополнение 2:

- согласованы с Агентством Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций 24 мая 2005 года;
- утверждены решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 14 апреля 2005 года № 7);
- введены в действие с 01 июля 2005 года.

Настоящий документ утвержден в соответствии с "Правилами деятельности маркет–мейкеров", одобренных собранием членов АО "Казахстанская фондовая биржа" (именуемого в дальнейшем Биржа) категории "К", "Р", "Н" (протокол от 14 октября 1999 года №7) и утвержденных постановлением Директората Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 26 октября 1999 года № 462 и Приложением 2 к ним и устанавливает обязанности, права и ограничения прав членов Биржи, обладающих статусом маркет–мейкера облигаций международных финансовых организаций (именуемые далее "наднациональные облигации") *(данный абзац изменен решением Биржевого совета от 15 января 2004 года)*.

Маркет–мейкер обязан:

1. В течение всего торгового дня поддерживать в торговой системе Биржи хотя бы одну твердую котировку на покупку и одну твердую котировку на продажу (именуемые далее обязательные котировки) в объеме (как на покупку, так и на продажу) не менее 10.000 единиц валюты, в которой номинированы облигации, по номинальной стоимости *(данный пункт дополнен решением Биржевого совета от 14 апреля 2005 года)*.
2. Поддерживать спрэд между наилучшими обязательными котировками (по разнице в абсолютном выражении между значениями доходности к погашению, рассчитанной в соответствии с применяемой на Бирже методикой расчета доходности облигаций, котировок на покупку и продажу) в размере, не превышающем двух процентных пунктов *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 14 апреля 2005 года)*.
3. При снятии или удовлетворении обязательной котировки в течение одной минуты устанавливать новую обязательную котировку.

Маркет–мейкер вправе:

4. Изменять цены ранее объявленных обязательных котировок при условии соблюдения установленного настоящим документом спреда.
5. Отказаться выставлять обязательные котировки, если по данной эмиссии наднациональных облигаций объем купленных ценных бумаг за минусом проданных или объем проданных ценных бумаг за минусом купленных в течение торгового дня превысил сумму в размере 1.000.000 долларов США (или иной валюты, в которой выражена эмиссия наднациональных облигаций) по номинальной стоимости.
6. В случае если на рынке складывается чрезвычайная ситуация, объявить тайм-аут на срок не более одного часа. 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.
7. Не платить комиссионный сбор по сделкам с наднациональными облигациями, заключенным на бирже в качестве маркет–мейкера.

Ответственность маркет–мейкера

8. В случае нарушения маркет–мейкером условий исполнения своих обязанностей, установленных настоящим документом, 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)*.
9. Нарушение условий пункта 3 настоящего документа на срок пять минут и более, за исключением случаев, указанных в пунктах 5 и 6, признается отказом маркет–мейкера устанавливать обязательные котировки. За отказ маркет–мейкера устанавливать 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)*.

10. 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*).

Освобождение маркет–мейкера от выполнения своих обязанностей

11. Маркет–мейкер имеет право не исполнять свои обязанности, указанные в пунктах 1–3 настоящего документа, при получении соответствующего уведомления со стороны Биржи, в следующих случаях:
- 11.1. На международном рынке наднациональных облигаций происходит колебание цен свыше 1.000 базовых пунктов за пять рабочих дней либо другие значительные события, которые могут привести к ситуации неопределенности на рынке наднациональных облигаций.
 - 11.2. Государственными органами Республики Казахстан вносятся изменения в законодательство Республики Казахстан, которые могут существенно повлиять на внутренний рынок наднациональных облигаций.
 - 11.3. Происходят события внутри Республики Казахстан или за ее пределами, которые могут оказать значительное влияние на внутренний рынок наднациональных облигаций.
12. Решение об освобождении маркет–мейкеров от исполнения обязанностей, указанных в пунктах 1–3 настоящего документа, в случаях, указанных в пункте 11 настоящего документа, до созыва Биржевого совета принимается Правлением Биржи.

Президент

Карасаев Д.Б.