

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н о

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

(протокол от 19 декабря 1999 года № 12)

Введено в действие

с 20 декабря 1999 года

Дополнение 3 к Правилам деятельности маркет–мейкеров

Приложение 3

к Правилам деятельности
маркет–мейкеров

СПЕЦИФИКАЦИЯ статуса маркет–мейкера доллара США

г. Алматы

1999

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения и дополнения № 1:

- утверждены решением Комитета Биржевого совета по валютному рынку ЗАО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 25 января 2000 года № 1);
- введены в действие с 01 февраля 2000 года.

2. Изменения № 2:

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

3. Дополнение № 3:

- утверждено решением Биржевого совета ЗАО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол от 05 июля 2002 года);
- введено в действие с 10 июля 2002 года.

4. 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"".

Статья 1. Статус маркет-мейкера

1. Статус маркет-мейкера доллара США 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 доллара США, должен иметь собственный капитал в размере не менее эквивалента в казахстанских тенге десяти миллионов долларов США *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 25 января 2000 года)*.

Статья 3. Обязанности маркет-мейкера

3. Маркет-мейкер доллара США обязан:
 - 3.1. Уплачивать ежемесячный членский взнос в размере эквивалента в казахстанских тенге 500 долларов США *(данный пункт изменен решением Биржевого совета от 25 января 2000 года)*.

- 3.2. В течение дополнительной сессии поддерживать в торговой системе Биржи хотя бы одну твердую котировку на покупку и одну твердую котировку на продажу (именуемые далее "Обязательные котировки").

В случае, если банки – корреспонденты Биржи по доллару США по каким-либо причинам не осуществляют расчеты в долларах США в день торгов (по причине праздничных дней, наступления обстоятельств непреодолимой силы или по иным возможным причинам), то маркет-мейкер доллара США обязан поддерживать в течение дополнительной сессии (до 15.30 алматинского времени) в торговой системе Биржи обязательные котировки доллара США с расчетами на день T+n, где T – день торгов по доллару США, n – длительность перерыва в осуществлении банками – корреспондентами Биржи по доллару США расчетов в долларах США (в днях) *(данный абзац включен решением Биржевого совета от 05 июля 2002 года)*.

- 3.3. Поддерживать спрэд между наилучшими обязательными котировками в размере, не превышающем 0,05 тенге при нетто-позиции до 1 миллиона долларов США, и 0,1 тенге при нетто-позиции до 2 миллионов долларов США. При этом объем обязательной котировки, доступный к заключению сделки в любой момент времени в течение всего торгового дня, должен составлять не менее 300 тысяч долларов США. Объем обязательной котировки может быть менее 300 тысяч долларов США, если удовлетворение обязательной котировки может привести к превышению нетто-позиции маркет-мейкера более 2.000.000 долларов США

или

поддерживать спрэд между наилучшими обязательными котировками в размере, не превышающем 0,1 тенге при нетто-позиции до 2 миллионов долларов США. При этом объем обязательной котировки, доступный к заключению сделки в любой момент времени в течение всего торгового дня, должен составлять не менее 1 миллиона долларов США. Объем обязательной котировки может быть менее 1 миллиона долларов США, если удовлетворение обязательной котировки может привести к превышению нетто-позиции маркет-мейкера более 2.000.000 долларов США.

(Данный пункт изменен решением Биржевого совета от 25 января 2000 года).

- 3.4. При снятии или удовлетворении обязательной котировки, в течение 1 минуты устанавливать новую обязательную котировку.
- 3.5. *(Данный пункт исключен решением Биржевого совета от 25 января 2000 года).*

Статья 4. Права маркет-мейкера

4. Маркет-мейкер доллара США 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. Отказаться выставлять обязательные котировки, если объем нетто-позиции достиг пяти миллионов долларов США.
 - 4.4. 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.
 - 4.5. Не платить комиссионный сбор по сделкам, заключаемым на биржевых торгах иностранными валютами.

Статья 5. Ответственность маркет-мейкера

5. 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).*
6. Нарушение условий пункта 3.4 настоящей спецификации на срок пять минут и более, за исключением случаев, указанных в пунктах 4.1 и 4.4, 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).*
7. 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 6. Освобождение маркет-мейкера от выполнения своих обязанностей

8. Маркет-мейкер имеет право не исполнять свои обязанности, указанные в пункте 3.3. настоящей спецификации, в случаях когда:
 - 8.1. Банки – операторы валютного рынка на внебиржевом межбанковском рынке устанавливают котировки на покупку и на продажу, спред по которым составляет величину, превышающую 0,25 тенге. Для определения данной ситуации используются данные компании REUTERS PLC и ее дочерних подразделений.

- 8.2. Государственными органами Республики Казахстан вносятся изменения в законодательство Республики Казахстан, которые могут оказать значительное влияние на ситуацию на валютном рынке Республики Казахстан.
- 8.3. Происходят события внутри Республики Казахстан или за ее пределами, которые могут оказать значительное влияние на ситуацию на валютном рынке Республики Казахстан.
9. Маркет-мейкеры получают право не исполнять обязанности, указанные в пункте 3.3 настоящей спецификации, в случаях, указанных в пункте 8 настоящей спецификации, только после соответствующего уведомления со стороны Биржи.
10. Решение об освобождении маркет-мейкеров от исполнения обязанностей, указанных в пункте 3.3 настоящей спецификации, в случаях, указанных в пункте 8 настоящей спецификации, до созыва Комитета Биржевого совета по валютному рынку принимается Правлением Биржи.

(Данная статья включена решением Биржевого совета от 25 января 2000 года).

Президент

Карасаев Д.Б.