

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Басқармасының шешімімен
(2016 жылдың 30 маусымындағы
№ 65 отырыс хаттамасы)
б е к і т і л д і

2016 жылдың 01 шілдесінен бастап
қолданысқа енгізілді

Биржа мүшелерінің мониторингін жүзеге асыру **ТӘРТІБІ**

Алматы қ.

2016

Осы Тәртіп Қазақстан Республикасының заңнамасына және "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) ішкі құжаттарына сәйкес әзірленді және Биржа мүшелерінің, оның ішінде клирингтік қатысушылар мәртебесіне иеленген мүшелерінің Қазақстан Республикасы заңнамасының және Биржаның ішкі құжаттарының талаптарына сәйкестігі мәніне мониторингті жүзеге асыру тәртібін айқындайды.

1 бап. Жалпы қағидалар

1. Осы тәртіппен пайдаланылатын ұғымдар Биржаның ішкі құжаттарында пайдаланылатын, оның мүшелері қызметінің шарттары мен тәртібін регламенттейтін мағыналарда қолданылады.
2. Осы Тәртіптің мақсаттары үшін Биржа мүшелері деп, Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес бағалы қағаздар нарығын мемлекеттік реттеуді жүзеге асыратын Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкін (бұдан әрі – Ұлттық Банк) және халықаралық қаржы ұйымы және халықаралық құқық субъектісі болып табылатын Еуразиялық Даму Банкін қоспағанда, Биржада мүшелігі кез келген негіздер бойынша тоқтатыла тұрған шетелдік мүшелерін, ұйымдарды қоса алғанда, Биржаның барлық мүшелері, сондай-ақ Биржаның клирингтік қатысушылары түсініледі.
3. Биржа мүшелерінің олардың есеп берушілігі мен қызметі туралы ақпаратты беруінің толықтығы мен уақтылылығын бақылау мақсатында Биржа мүшелерінің ақпаратты ашуына мониторингті жүзеге асырады.

Биржа оның мүшелерінің төлем қабілеттілігінің нашарлау жағдайларын анықтау мақсатында оның мүшелерінің қаржылық жағдайына мониторинг жүргізеді.

4. Биржа мүшелері мониторингінің нәтижелері тек қана Биржаның ішкі мақсаттары үшін пайдаланылады.

Биржа мүшелері ақпаратты ашу, Биржаға есеп берушілікті және/немесе құжаттарды ұсыну бойынша талаптарды бұзған жағдайлар туралы Ұлттық банкті тоқсан сайын хабардар етеді.

2 бап. Биржа мүшесінің ақпараттар ашуының тәртібі

1. Биржа мүшесі ақпаратты ашуды, Мүшелік туралы қағиданың 16 бабында және Мүшелік туралы қағиданы 8 және 9 қосымшаларында, сондай-ақ клирингтік қатысушылар туралы қағиданың 10 бабында көрсетілген есеп берушілікті және/немесе құжаттарды (бұдан әрі – Ақпарат), тиісінше мүшелік туралы қағидада және Клирингтік қатысушылар туралы қағидада белгіленген мерзімдерде, сондай-ақ Қазақстан Республикасы заңнамасының талаптарына және Биржаның өзге де ішкі құжаттарына сәйкес ұсыруды жүзеге асырады.
2. Биржа мүшесінің ақпаратты ашуы Биржаға оның мүшесімен ақпаратты беру тәртібі туралы келісімге сәйкес is2in жүйесі арқылы жүзеге асырылады.
3. Биржа мүшесі is2in жүйесін Биржа мүшесі үшін бөлінген биржа интернет-ресурсының арнайы бөлімі (бұдан әрі – Арнайы бөлім) арқылы пайдаланады.

3 бап. Биржа мүшелерінің Ақпаратты ашуына мониторинг

1. Мониторингті негізгі функцияларының бірі ақпаратты ашу мониторингі болып табылатын Биржа бөлімшесі (бұдан әрі – Мониторинг бөлімі) жүзеге асырады.

2. Мониторинг бөлімі Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның ішкі құжаттарында белгіленген ақпаратты ашу мерзімдерін бақылайды.
3. Биржа мүшелерінен алынған ақпарат Биржаның интернет-ресурсында биржалық ақпаратты тарату ережелерін реттейтін, Биржаның ішкі құжатында белгіленген құрамда, көлемде және тәртіппен жарияланады.
4. Биржа мүшелері ақпаратты ашу мониторингін жүзеге асыру кезінде ақпаратты мына бөлігінде тексереді:
 - 1) Ақпаратты ұсыну тәсілі;
 - 2) Ақпаратты уақтылы ұсыну;
 - 3) Ақпараттың толықтығы;
 - 4) Ақпараттың дұрыс ресімделуі;
 - 5) Ақпаратта елеулі қателердің, қате басылулардың және дәлсіздіктердің болуы (болмауы);
 - 6) Ақпарат мазмұнының шынайылығын.
5. Ақпаратты ұсыну тәсілі бөлігінде тексеру кезінде Биржа ақпараттың Биржаға is2in жүйесі арқылы (Арнайы бөлім арқылы) немесе Биржаның мүшелігі туралы қағидада және өзге ішкі құжаттарда белгіленген өзге де рұқсат етілетін тәсілдермен берілуін тексереді.
6. Ақпаратты уақтылы ұсыну бөлігінде тексеру кезінде Биржа осы ұсыну уақытының мүшелік туралы ережеде, клирингілік қатысушылар туралы Ережеде және Биржаның өзге ішкі құжаттарында белгіленген мерзімдерге сәйкестігін тексереді.
7. Ақпараттың толықтығы мен ресімдеудің дұрыстығы бөлігінде Биржа тексерген кезде ақпараттың Мүшелік туралы қағидада, Клирингілік қатысушылар туралы қағидада және Биржаның өзге ішкі құжаттарында белгіленген талаптарға, Биржаға беруге жататын құжаттар мен өзге де материалдардың мазмұны бойынша сәйкестігін тексереді.
8. Ақпараттағы қателердің, қате басылулардың және дәлсіздіктердің болуы (болмауы) бөлігінде тексеру кезінде Биржа ақпаратта ақпарат пайдаланушыларды жаңылыстыруға қабілетті қателердің, қате басылулардың және дәлсіздіктердің болуын (болмауын) тексереді.
9. Ақпараттың дұрыстығы бөлігінде тексеру кезінде Биржа ішінара және шектеулі түрде, өзінің мүмкіндіктері мен құзыреті шеңберінде Ақпараттың жекелеген элементтері арасындағы айқын сәйкессіздіктер мен қайшылықтардың болуы тұрғысынан, сондай-ақ басқа көздерден, ең алдымен бұқаралық ақпарат құралдарынан Биржаға қолжетімді Ақпарат пен ашық сипаттағы мәліметтер арасындағы айқын сәйкессіздіктер мен қайшылықтар тұрғысынан Ақпаратты тексереді.

4 бап.

Биржа мүшесінен алынған Ақпаратты тексеру тәртібі

1. Биржа мүшесінен is2in жүйесі арқылы алынған ақпарат оның түсуіне қарай Биржаның келесі қызметкерлерінің екі кезеңдік тексеру процедурасынан өтеді:
 - 1) бірінші кезеңде – Мониторинг бөлімінің маманы;
 - 2) екінші кезеңде – Мониторинг бөлімінің бастығы немесе оның орынбасары (оның міндетін атқарушы тұлға).
2. Ақпаратты тексеру кезінде Арнайы бөлімде оның мәртебесі – "Тексерілуде" – тексерушінің тегі мен аты-жөні көрсетіледі.

3. Биржа мүшесі берген Ақпаратты тексерудің әрбір кезеңі аяқталғаннан кейін осы Биржа мүшесіне оның электрондық мекен-жайына тексерілетін ақпараттың мәртебесі туралы хабарлама ("Тексерілді", "Пысықтауды талап етеді", "Бас тартылды", "Жариялауға жіберілді") жіберіледі, ол сондай-ақ арнайы бөлімде көрсетіледі және ақпаратты тексерген Биржа қызметкерінің тегі мен аты-жөні көрсетіледі.
4. Егер Ақпаратты тексеру сатысында оның қолданылатын талаптарға сәйкессіздігі анықталған жағдайда, мұндай ақпаратқа "Пысықтауды талап етеді" немесе "Бас тартылды" мәртебесі беріледі және Мониторинг бөлімі is2ip жүйесі арқылы немесе электрондық пошта арқылы ақпарат берген Биржа мүшесін ақпаратты Биржаға ұсыну үшін белгіленген мерзімдерде оны түзету және/немесе ауыстыру қажеттігі туралы хабардар етеді.
5. Мониторинг бөлімі ақпаратты тексергеннен кейін ақпарат Биржаның бэк-офисіне (Ақпарат түріне сәйкес келетін бөлімге) автоматты түрде беріледі, онда Биржа мүшелерінің мониторингін жүзеге асыратын Биржа қызметкерлері сақтау және кейіннен пайдалану үшін орналастырылады.
6. Тексеруден өткеннен кейін Биржа мүшелерінен алынған ақпарат оған "Жариялауға жіберілді" деген мәртебе берілгеннен кейін бес минут ішінде Биржаның интернет-ресурсындағы Биржа мүшелерінің деректері берілген беттерінде, биржалық ақпаратты тарату ережелерін реттейтін, Биржаның ішкі құжатында белгіленген құрамда, көлемде және тәртіппен жарияланады.
7. Мүшелік туралы қағидамен белгіленген, рұқсат етілген өзге тәсілдермен Биржа мүшелерінен алынған Ақпарат тексеруден өткеннен кейін Биржаның интернет-ресурсының Биржа мүшелері деректерінің беттерінде, биржалық ақпаратты тарату ережелерін реттейтін, Биржаның ішкі құжатымен белгіленген құрамда, көлемде және тәртіпте жарияланады.

5 бап.

Биржа мүшесінің қаржылық жағдайына мониторинг

1. Биржа мүшесінің қаржылық жай-күйінің мониторингін, Биржаға осы ақпараттың түсуіне қарай, Биржа мүшелері берген ақпарат негізінде Мониторинг бөлімі жүзеге асырады.
2. Биржа мүшесінің қаржылық жағдайына жүргізілетін мониторинг мыналарды қамтиды:
 - 1) Биржа мүшесінің қолданыстағы заңнама талаптарына сәйкес пруденциалдық нормативтерді және/немесе мәні бойынша басқа ұқсас нормативтерді немесе көрсеткіштерді орындауын тексеру;
 - 2) контроль выполнения членом Биржи требований к минимальным размерам уставного и собственного капиталов, установленных законодательством Республики Казахстан и Положением о членстве – для членов Биржи, являющихся юридическими лицами Республики Казахстан, и Положением о членстве – для иностранных членов Биржи;
 - 3) оценку финансового состояния члена Биржи в соответствии с Методикой оценки финансового состояния членов Биржи.

Статья 6.

Проверка соблюдения членом Биржи требований законодательства и внутренних документов Биржи

1. Годовой план мониторинга членов Биржи состоит из проверок членов Биржи на соблюдение ими требований законодательства и внутренних документов Биржи, состав которых предусмотрен пунктом 2 настоящей статьи.

2. Проверки соблюдения членом Биржи требований законодательства и внутренних документов Биржи включают в себя:
 - 1) проверку полноты и своевременности раскрытия информации членом Биржи, которая осуществляется в соответствии со статьями 3 и 4 настоящего Порядка;
 - 2) мониторинг финансового состояния члена Биржи, который осуществляется в соответствии со статьей 5 настоящего Порядка;
 - 3) проверку выполнения членом Биржи требований к его системе управления рисками, которая осуществляется в соответствии с пунктом 3 настоящей статьи;
 - 4) проверку выполнения членом Биржи требований законодательства Республики Казахстан и внутренних документов Биржи при участии в проводимых Биржей торгах, осуществлении предторговых и постторговых процедур и иных действий, связанных с участием в проводимых Биржей торгах и членством на Бирже, которая осуществляется структурными подразделениями Биржи в рамках их компетенции и в соответствии с внутренними документами Биржи.
3. Проверка выполнения членом Биржи требований к его системе управления рисками осуществляется Отделом мониторинга ежегодно на основании соответствующих отчетов данного члена Биржи по мере поступления таких отчетов. Результаты проверки выполнения членом Биржи требований к его системе управления рисками включаются в отчеты о результатах мониторинга членов Биржи.

Если по результатам такой проверки на основании отчета члена Биржи выявлено, что система управления рисками данного члена Биржи соответствует не менее чем 80 % требований (критериев), установленных применимым законодательством, то считается, что данный член Биржи выполняет требования к его системе управления рисками.

Если по результатам такой проверки на основании отчета члена Биржи выявлено, что система управления рисками данного члена Биржи соответствует или частично соответствует не менее чем 50 % требований (критериев), установленных применимым законодательством, то считается, что данный член Биржи частично выполняет требования к его системе управления рисками.

Если по результатам такой проверки на основании отчета члена Биржи выявлено, что система управления рисками данного члена Биржи не соответствует более чем 50 % требований (критериев), установленных применимым законодательством, то считается, что данный член Биржи не выполняет требования к его системе управления рисками.

Статья 7. Отчетность о результатах мониторинга членов Биржи

1. Отдел мониторинга составляет отчет о результатах мониторинга членов Биржи (далее – Отчет) и предоставляет его Расчетной палате, Клиринговой палате Биржи и выносит его на рассмотрение Правления Биржи:
 - 1) ежемесячно не позднее последнего рабочего дня месяца, следующего за отчетным с включением информации о членах валютного рынка и рынка деривативов Биржи;
 - 2) ежеквартально не позднее последнего рабочего дня месяца, следующего за истекшим календарным кварталом с включением информации о всех членах Биржи.
2. Для составления Отчета структурные подразделения Биржи, включая Департамент торгов, Клиринговую палату, Расчетную палату, по мере

выявления предоставляют Отделу мониторинга сведения о нарушениях членами Биржи требований законодательства и внутренних документов Биржи, допущенных при участии в проводимых Биржей торгах, осуществлении предторговых и постторговых процедур и иных действий, связанных с участием в проводимых Биржей торгах и членством на Бирже.

3. Отчет включает в себя сведения о:
 - 1) нарушении членами Биржи требований по раскрытию Информации, установленных законодательством Республики Казахстан и внутренними документами Биржи;
 - 2) результатах оценки финансового состояния членов Биржи, осуществленной в соответствии с Методикой оценки финансового состояния членов Биржи;
 - 3) выполнении членами Биржи пруденциальных нормативов и/или иных сходных по сути нормативов или показателей в соответствии с требованиями применимого законодательства;
 - 4) выполнении членами Биржи требований к минимальным размерам уставного и собственного капиталов, установленных законодательством Республики Казахстан и Положением о членстве – для членов Биржи, являющихся юридическими лицами Республики Казахстан, и Положением о членстве – для иностранных членов Биржи;
 - 5) финансовых показателях членов Биржи, в том числе о наличии у них прибыли или убытков на последнюю отчетную дату;
 - 6) выполнении членами Биржи требований к системам управления рисками;
 - 7) нарушениях членами Биржи требований законодательства и внутренних документов Биржи, допущенных при участии в проводимых Биржей торгах, осуществлении предторговых и постторговых процедур и иных действий, связанных с участием в проводимых Биржей торгах и членством на Бирже.
4. Правление Биржи на своем ближайшем заседании рассматривает Отчет и, при необходимости, принимает в отношении отдельных членов Биржи меры, предусмотренные внутренними документами Биржи.
5. Подразделение мониторинга не позднее пятого рабочего дня, следующего за днем рассмотрения Правлением Биржи Отчета, предоставляет Национальному Банку сведения о случаях нарушения членами Биржи требований по раскрытию Информации.

Статья 8. Ограничение ответственности Биржи

Биржа не несет ответственности за достоверность Информации, раскрываемой членом Биржи, поскольку Биржа не имеет возможности проверить и/или подтвердить ее достоверность. При этом Биржа прилагает все возможные разумные усилия для проверки Информации на предмет ее достоверности.