

“Təsdiq edilmişdir”

Azərbaycan Respublikasının Qiymətli

Kağızlar üzrə Dövlət Komitəsi

Qərar № 31-q

“14” “dekabr” 2015-ci il

Sədr

R. Aslanlı

Fond birjasının məlumatları açıqlaması

Qaydası

1. Ümumi müddəalar

1.1. Bu Qayda “Qiymətli kağızlar bazarı haqqında” Azərbaycan Respublikasının Qanununun (bundan sonra - Qanun) 48.3-cü maddəsinə uyğun olaraq hazırlanmışdır.

1.2. Bu Qayda Azərbaycan Respublikasının ərazisində fəaliyyət göstərən fond birjası tərəfindən (bundan sonra – birja) onun fəaliyyəti, ticarətə buraxılmış qiymətli kağızlar və törəmə maliyyə alətlərinin tələb və təklif qiymətləri, həmçinin onlarla bağlanmış əqdlərlə bağlı məlumatların açıqlanmasına dair tələbləri müəyyən edir.

1.3. Bu Qaydada istifadə olunan əsas anlayışlar:

1.3.1. ticarət sistemi - ticarətin keçirilməsi üçün nəzərdə tutulmuş proqram-texniki vasitələrin məcmusu;

1.3.2. ticarət üsulu – birjanın ticarət sistemi vasitəsi ilə sifarişlərin uzlaşması yolu ilə əqdlərin bağlanması üsuludur;

- 1.3.3. ticarət günü – birja tərəfindən qeyri-ticarət günü olaraq elan edilməmiş iş günüdür. Baza aktivləri xarici bazarlarda ticarət olunan törəmə maliyyə alətləri ilə ticarət təşkil olunduqda, ticarət günləri həmin bazarlarda tətbiq edilən iş günləri olaraq qəbul edilir;
- 1.3.4. ticarət saatları – birjada ticarət gününün ticarətin keçirildiyi hissəsidir;
- 1.3.5. kotirovka – qiymətli kağızlarının alınması və ya satılması üçün ticarət iştirakçısının təklif etdiyi qiymətdir;
- 1.3.6. kotirovka spreadi – market meykerin alış və satış qiymətlərini müəyyən edərkən riayət etməli olduğu, qiymətli kağızların cari qiymətinə nəzərən aşağı və yuxarı qiymət dəyişməsi arasındakı fərkdir;
- 1.3.7. kross sifariş – birjanın ticarət sistemində sifarişlərin reyestrinə daxil edildiyi zaman kross əqdin bağlanılmasına səbəb ola biləcək sifarişdir;
- 1.3.8. kross əqd – birja üzvünün eyni bir əqd üzrə həm alıcının, həm də satıcının kontragenti qismində çıxış etdiyi əqdlərdir;
- 1.3.9. ticarət simvolu– birjada ticarətə buraxılan hər bir qiymətli kağız və törəmə maliyyə alətini ticarət sistemində identifikasiya edən qısa koddur.
- 1.3.10. təminat əmsalı - repo müddəti ərzində Repo predmeti olan investisiya qiymətli kağızlarının bazar qiymətinin aşağı düşməsi zamanı repo üzrə öhdəliklərin yerinə yetirilməməsi risklərinin qarşısının alınması məqsədi ilə Repo açılış qiymətinin hesablanması üzrə birja tərəfindən tətbiq edilən əmsaldır.

2. Birja tərəfindən açıqlanan məlumatlar

- 2.1. Birja ticarətə buraxılmış qiymətli kağızlar və törəmə maliyyə alətləri üzrə ticarətə dair məlumatları, həmçinin emitentlər tərəfindən təqdim edilən və öz fəaliyyəti ilə bağlı məlumatları bu Qaydaya uyğun olaraq açıqlayır.
- 2.2. Birja ticarət zamanı bu Qaydanın 3.1-ci və 3.4-cü bəndləri ilə müəyyən edilən məlumatların bütün üzvlər üçün eyni səviyyədə açıq olmasını təmin edir.
- 2.3. Ticarət öncəsi və bağlanmış əqdlərə dair məlumatların açıqlanması maliyyə bazarlarının sabitliyinin pozulması və ya ölkə iqtisadiyyatına mənfi təsir göstərə bildiyi təqdirdə, Qiymətli Kağızlar üzrə Dövlət Komitəsi (bundan sonra – Komitə) məlumatların açıqlanmasını təxirə salır. Həmin məlumatların açıqlanması Komitənin birjaya təqdim etdiyi yazılı bildiriş əsasında təxirə salınır.

3. Ticarət öncəsi məlumatların açıqlanması

3.1. Birja ticarət üsulundan asılı olaraq qiymətli kağızlarla (qiymətli kağızların yerləşdirilməsi üzrə keçirilən hərracları istisna olmaqla) və törəmə maliyyə alətləri ilə bağlı aşağıdakı məlumatları ticarətdən əvvəl davamlı olaraq ticarət sistemi vasitəsilə birja üzvlərinə açıqlayır:

3.1.1. fasiləsiz ticarət zamanı bir qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə aləti üzrə eyni qiymət ilə yerləşdirilmiş sifarişlərin və həmin sifarişlərdə əks olunmuş qiymətli kağızların ümumi sayını, həmçinin qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə alətinin kodu, növü və qiymətli kağızın emitentinin adı göstərilməklə, ən azı 5 ən yaxşı alış və satış təklifini;

3.1.2 kotirovkalara əsaslanan ticarət zamanı hər market-meyker tərəfindən yerləşdirilən ən yaxşı alış və satış kotirovkasını;

3.1.3. auksion (hərrac) ticarəti zamanı hər qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə aləti üzrə ticarət alqoritmini ən iri ticarət həcmi təmin edən qiyməti və həmin qiymət səviyyəsində alınıb-satıla biləcək qiymətli kağızların sayını, həmçinin qiymətli kağız və ya maliyyə alətinin kodunu, növünü və qiymətli kağızın emitentinin adını;

3.1.4. birjanın ticarət üsulu bu Qaydanın 3.1.1-3.1.3-cü yarımbəndlərində göstərilən ticarət üsullarının heç birinə uyğun olmadıqda və ya həmin üsulların bir neçəsinin birləşməsindən təşkil edildikdə, sifarişlərin və ya kotirovkaların qiymətini və həmin sifariş və kotirovkalarda əks olunmuş qiymətli kağızların sayını, qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə alətinin kodunu, növünü və qiymətli kağızın emitentinin adını.

3.2. Birjanın ticarət sistemində kross sifarişlər yerləşdirildiyi halda, birja bu Qaydanın 3.1.1-ci yarımbəndi ilə müəyyən edilən məlumatlardan əlavə olaraq, bu barədə məlumatı ticarət sistemi vasitəsilə açıqlayır.

3.3. Ünvanlı satış əqdləri üzrə yerləşdirilmiş sifarişlərə dair ticarət öncəsi məlumatlar birja tərəfindən açıqlanmır.

3.4. Birja repo əməliyyatları üzrə aşağıdakı məlumatları açıqlayır:

3.4.1. repo predmeti olan investisiya qiymətli kağızları;

3.4.2. təminat əmsalı (faizlə);

3.4.3. repo predmeti ola bilən investisiya qiymətli kağızlarının cari qiyməti;

3.4.4. repo açılış qiyməti.

3.5. Bu Qaydanın 3.1-ci və 3.4-cü bəndlərində göstərilən məlumatlar birja tərəfindən ödənişli əsaslarla real-vaxt rejimində birja üzvü olmayan şəxslərə açıqlana bilər. Həmin

məlumatların açıqlanmasının vaxtı, şərtləri və üsulları birjanın məlumatların açıqlanmasına dair daxili qaydaları ilə müəyyən edilir.

4. Bağlanmış əqdlərə dair məlumatların açıqlanması

4.1. Birja ticarətə buraxılmış hər qiymətli kağız üzrə bağlanmış əqdlərə dair (ünvanlı satış əqdləri istisna olmaqla) aşağıdakı ümumiləşdirilmiş məlumatları ticarət gününün sonunda öz internet səhifəsi vasitəsilə açıqlayır:

4.1.1. əqdlərin ümumi sayı;

4.1.2. əqdin keçirildiyi tarix (gün-ay-il);

4.1.3. əqdin predmeti Azərbaycan Respublikasının ərazisində buraxılmış qiymətli kağızlar olduqda, onların buraxılışının dövlət qeydiyyat nömrəsi, ölkə hüdüdlərindən kənar buraxılan qiymətli kağızlar olduqda isə İSO 6166 beynəlxalq standartına uyğun olaraq, beynəlxalq eyniləşdirmə kodu (İSİN) və ya onların buraxıldığı ölkədə qiymətli kağızların identifikasiya edilməsi üçün müəyyən edilmiş digər kodu;

4.1.4. əqdin predmeti olan qiymətli kağızların emitentinin tam adı;

4.1.5. əqdin predmeti olan qiymətli kağızların növü;

4.1.6. ticarət günü ərzində qeydə alınmış maksimal alğı-satqı qiyməti;

4.1.7. ticarət günü ərzində qeydə alınmış minimal alğı-satqı qiyməti;

4.1.8. qiymətli kağızın açılış qiyməti;

4.1.9. qiymətli kağızın bağlanış qiyməti;

4.1.10. əqd üzrə ödəniş vasitəsi kimi istifadə edilən İSO 4217 beynəlxalq standartına uyğun olaraq, valyuta kodu. Əqdin predmeti istiqraz olduqda qiymət faizlə ifadə olunur;

4.1.11. əqdlərin predmeti olan qiymətli kağızların sayı;

4.1.12. əqdlərin məbləği.

4.2. Birja hər bir qiymətli kağız üzrə ticarət günü ərzində bağlanmış ünvanlı əqdlərin ümumi həcmi üzrə məlumatı birjanın daxili qaydalarına uyğun olaraq açıqlayır.

4.3. Birja tərəfindən açıqlanmış əqdlərə dair məlumatlarda dəyişikliklər baş verdikdə birja bu barədə öz internet səhifəsi vasitəsilə məlumat açıqlayır.

4.4. Birja ticarətə buraxılmış qiymətli kağızlar və törəmə maliyyə alətləri üzrə aşağıdakı məlumatları hesabat ayından sonrakı ayın 5 (beş) iş günündən gec olmayaraq açıqlayır:

4.4.1. ilkin bazarda bağlanmış əqdlərin sayı və məbləği (ümumi və hər növ qiymətli kağız və törəmə maliyyə aləti üzrə ayrı-ayrılıqda) ;

- 4.4.2. təkrar bazarda bağlanmış əqdlərin sayı və məbləği (ümumi və hər növ qiymətli kağız və törəmə maliyyə aləti üzrə ayrı-ayrılıqda);
- 4.4.3. hər investisiya şirkəti tərəfindən bağlanmış əqdlərin sayı və məbləği (ümumi və hər növ qiymətli kağız və törəmə maliyyə aləti üzrə ayrı-ayrılıqda).
- 4.5. Birja ticarətə buraxılmış hər bir qiymətli kağız və törəmə maliyyə aləti üzrə hər təqvim ili üçün aşağıdakı məlumatları növbəti ilin birinci ayının 15 (on beş) iş günündən gec olmayaraq açıqlayır:
- 4.5.1. orta gündəlik dövriyyə (qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə aləti ilə təqvim ili ərzində bağlanmış əqdlərin məbləğinin, həmin ildə olan ticarət günlərinin sayına nisbəti kimi hesablanır (ünvanlı satış əqdləri nəzərə alınmaqla));
- 4.5.2. əqdlərin orta gündəlik sayı (qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə aləti ilə təqvim ili ərzində bağlanmış əqdlərin sayının, həmin ildə olan ticarət günlərinin sayına nisbəti kimi hesablanır (ünvanlı satış əqdləri nəzərə alınmaqla)).
- 4.6. Birja bu Qaydanın 4.1.1 - 4.1.3-cü və 4.1.5 - 4.1.12-ci yarımbəndləri ilə müəyyən edilmiş məlumatlardan əlavə törəmə maliyyə aləti üzrə aşağıdakı məlumatları açıqlayır:
- 4.6.1. törəmə maliyyə alətinin baza aktivləri;
- 4.6.2. müqavilələrin sayı;
- 4.6.3. fyuçerslər üzrə öhdəliklərin icra olunması günü və/ və ya opsiyonların ödəmə tarixi;
- 4.6.4. son ticarət günü;
- 4.6.5. gündəlik ticarət saatları;
- 4.6.6. qiymət dəyişməsinin həddi;
- 4.6.7. ödəmə üsulu;
- 4.6.8. törəmə maliyyə alətləri üzrə market - meyker fəaliyyəti barədə qeyd.
- 4.7. Baza aktivlərinin qiyməti, gəlirliliyi və məzənnə fərqi üzrə dəyişikliklər ilə aparılan marja ticarəti üzrə bağlanmış əqdlərə dair bu Qaydanın 4.1.2-ci və 4.1.12-ci yarımbəndlərində qeyd edilən məlumatlar, həmçinin həmin əqdlərin predmetinin birja tərəfindən müəyyən edilmiş ticarət simvolu və əqdlərin predmeti olan baza aktivləri barədə məlumat bu Qaydanın 4.1-ci bəndi ilə müəyyən edilmiş qaydada açıqlanır.
- 4.8. Birja bu Qaydanın 4-cü hissəsində qeyd edilən məlumatlara, həmin məlumatların açıqlandığı tarixdən 6 (altı) ay ərzində sərbəst çıxış imkanını təmin edir.

5. Birjanın fəaliyyətinə dair və emitentlər tərəfindən təqdim edilən məlumatların açıqlanması

5.1. Birja öz fəaliyyətinə dair aşağıdakı məlumatların öz internet səhifəsində açıqlanmasını təmin edir:

5.1.1. birjanın üzvləri barədə;

5.1.2. birjada market meyker fəaliyyətini həyata keçirən investisiya şirkətləri barədə;

5.1.3. qiymətli kağızları ticarət olunan emitentlər barədə;

5.1.4. ticarət saatları və birja tərəfindən ticarəti təşkil edilən bazarlar barədə;

5.1.5. birja tərəfindən təqdim edilən xidmətlər barədə;

5.1.6. birja tərəfindən hesablanan indekslər və onların hesablanması qaydası barədə;

5.1.7. birjanın xidmət haqları barədə;

5.1.8. birjanın daxili qayda və prosedurları barədə;

5.1.9. birjanın illik hesabatları;

5.1.10. birjanın təşkilati strukturu barədə;

5.1.11. kotirovkanın minimal həcmi barədə;

5.1.12. kotirovka spredinin maksimal və minimal hədləri barədə;

5.1.13. birja üzvlərinə qarşı tətbiq etdiyi sanksiyalar barədə;

5.1.14. reponun predmeti olan qiymətli kağızların siyahısı;

5.1.15. hərracın keçirilməsinin şərtləri barədə məlumat;

5.1.16. marja hədləri barədə məlumat.

5.2. Bu Qaydanın 5.1.1-5.1.4-cü yarımbəndlərində qeyd edilən məlumatların məzmunu birjanın məlumatları açıqlamasına dair daxili qaydaları ilə müəyyən edilir.

5.3. Bu Qaydanın 5.1.7-5.1.8, 5.1.11-5.1.12 və 5.1.14-5.1.16-cı yarımbəndlərində qeyd edilən məlumatlar, həmin məlumatlarda dəyişiklik baş verdiyi andan 5 (beş) iş günü ərzində açıqlanır.

5.4. Qanun ilə emitentlər tərəfindən birjanın internet səhifəsi vasitəsilə açıqlanması müəyyən edilən məlumatlar emitentlər tərəfindən birjaya təqdim edildiyi andan 1 (bir) iş günü ərzində birja tərəfindən açıqlanır.

6. Qiymətli kağızlar və törəmə maliyyə alətlərinin ticarətə buraxılmasına dair məlumatlar

6.1. Birja qiymətli kağızların və ya törəmə maliyyə alətlərinin ticarətə buraxılması, ticarətin dayandırılması və ya onların ticarətdən çıxarılmasına dair aşağıdakı məlumatların 1 (bir) iş günü ərzində öz internet səhifəsində açıqlanmasını təmin edir:

- 6.1.1. kütləvi təklif edilən investisiya qiymətli kağızlarına abunə yazılışının başlanılması barədə;
- 6.1.2. qiymətli kağızların listinqə daxil edilməsi və delistinqi barədə;
- 6.1.3. ticarətə buraxılmış və ticarəti dayandırılmış qiymətli kağız və ya törəmə maliyyə aləti barədə;
- 6.1.4. ticarəti dayandırılmış qiymətli kağızlar və törəmə maliyyə alətləri üzrə ticarətin bərpa edilməsi barədə;
- 6.1.5. qanunvericiliklə birja tərəfindən açıqlanmalı olan digər məlumatlar.