

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

С о г л а с о в а н

с АО "Клиринговый центр KASE"
решение Правления
АО "Клиринговый центр KASE"
(протокол заседания от 15 декабря
2023 года № 59)

У т в е р ж д е н

решением Совета директоров
АО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол заседания
от 07 февраля 2024 года № 4)

Введен в действие

с 08 февраля 2024 года

П О Р Я Д О К

передачи функционала по клиринговой
и расчетной деятельности и деятельности
центрального контрагента от
АО "Казахстанская фондовая биржа"
АО "Клиринговый центр KASE" по
валютному рынку и рынку деривативов

Разработчик: Клиринговая палата

г. Алматы

2024

**Порядок передачи функционала по клиринговой и расчетной деятельности
и деятельности центрального контрагента от АО "Казахстанская фондовая биржа"
АО "Клиринговый центр KASE" по валютному рынку и рынку деривативов**

Настоящий Порядок разработан в соответствии с законом Республики Казахстан "О рынке ценных бумаг", Правилами осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами, утвержденными постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 октября 2018 года № 254, уставом и внутренними документами (далее – ВД) АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), уставом и ВД АО "Клиринговый центр KASE" (далее – Клиринговый центр) и определяют условия и порядок передачи Биржей функционала по клиринговой и расчетной деятельности и деятельности центрального контрагента от Биржи Клиринговому центру по валютному рынку и рынку деривативов.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящем Порядке используются понятия, предусмотренные законодательством Республики Казахстан, ВД Биржи, а также следующие термины, определения и сокращения:
 - 1) **позиция** – обязательство и/или требование, возникшее у клирингового участника по отношению к Бирже в результате заключения сделки (сделок) с финансовыми инструментами и учитываемое на клиринговом счете клирингового участника;
 - 2) **Правила клиринга Биржи** – ВД Биржи "Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами";
 - 3) **Правила клиринга Клирингового центра** – ВД Клирингового центра "Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами";
 - 4) **учетный счет** – совокупность регистрационных записей и других обозначений в информационных системах Биржи, предназначенная для ведения внутреннего учета денег, числящихся на корреспондентских счетах Биржи в казахстанских тенге и/или иностранных валютах.
2. Биржа передает Клиринговому центру:
 - 1) клиринговые счета в торгово-клиринговой системе ASTS+ валютного рынка;
 - 2) клиринговые счета в торгово-клиринговой системе Spectra рынка деривативов;
 - 3) учетные счета, открытые во внутренней учетной системе Биржи участникам валютного рынка;
 - 4) учетные счета, открытые во внутренней учетной системе Биржи участникам рынка деривативов;
 - 5) позиции клиринговых участников по валютному рынку;
 - 6) позиции клиринговых участников по рынку деривативов.
3. Биржа на основании распоряжений клиринговых участников переводит на корреспондентский счет Клирингового центра:
 - 1) деньги, учитываемые на корреспондентских счетах Биржи, для обеспечения исполнения обязательств и обеспечения сделок с финансовыми инструментами клиринговых участников валютного рынка и рынка деривативов;
 - 2) гарантийные взносы клиринговых участников валютного рынка, учитываемые на корреспондентском счете Биржи;
 - 3) гарантийные взносы клиринговых участников рынка деривативов, учитываемые на корреспондентском счете Биржи.
4. Передача и перевод, указанные в пунктах 2 и 3 настоящего Порядка, осуществляются:
 - 1) после завершения клиринга и расчетов на валютном рынке и клиринга и расчетов на рынке деривативов в рабочий день, предшествующий дате начала осуществления Клиринговым центром клиринговой деятельности по сделкам, заключенным на

- валютном рынке и на рынке деривативов (далее – день передачи позиций);
- 2) в соответствии с настоящим Порядком и на основании соответствующих договоров, заключенных между Клиринговым центром и клиринговыми участниками.
 5. Клиринговый центр до дня передачи позиций обеспечивает заключение с клиринговыми участниками договоров о клиринговом обслуживании. Датой начала действия таких договоров должна быть дата начала выполнения Клиринговым центром клиринговой деятельности по валютному рынку и рынку деривативов.
 6. Клиринговый центр уведомляет Биржу о предполагаемом дне передачи позиций за 15 рабочих дней до его наступления. Биржа уведомляет клиринговых участников о дне передачи позиций за 10 рабочих дней до его наступления официальным письмом, отправленным по электронной почте, и соответствующим информационным сообщением на официальном интернет-сайте Биржи.
 7. Биржа в день передачи позиций после закрытия торгов:
 - 1) лишает всех членов Биржи, которым ранее был присвоен статус "клиринговый участник валютного рынка", этого статуса;
 - 2) исключает из списка принятых на клиринговое обслуживание все финансовые инструменты валютного рынка;
 - 3) лишает всех членов Биржи, которым ранее был присвоен статус "клиринговый участник рынка деривативов", этого статуса;
 - 4) исключает из списка принятых на клиринговое обслуживание все финансовые инструменты рынка деривативов.

Глава 2. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ПОЗИЦИЙ И ДЕНЕГ

8. Клиринговый участник не позднее 12:00 часов дня передачи позиций обязан предоставить Бирже распоряжение, составленное по форме приложения к настоящему Порядку.
9. В случае, если клиринговый участник не предоставил распоряжение в указанный срок, Биржа отстраняет его от торгов в день передачи позиций и в тот же день проводит процедуры ликвидации позиций в соответствии с нормами Правил клиринга Биржи в отношении неисполненных требований и обязательств.
10. На основании распоряжений клирингового участника, указанного в пункте 8 настоящего Порядка, Биржа проводит фиксацию и сверку позиций, денег и размеров клирингового гарантийного фонда клирингового участника по состоянию на конец дня передачи позиций.
11. После фиксации и сверки согласно пункту 10 Биржа по окончании торгов и клиринговых процедур дня передачи позиций, а также в строгом соответствии с распоряжением участника торгов передает Клиринговому центру:
 - 1) клиринговые счета в торгово-клиринговой системе ASTS+ валютного рынка;
 - 2) клиринговые счета в торгово-клиринговой системе Spectra рынка деривативов;
 - 3) учетные счета, открытые во внутренней учетной системе Биржи участникам валютного рынка;
 - 4) учетные счета, открытые во внутренней учетной системе Биржи участникам рынка деривативов;
 - 5) позиции клиринговых участников по валютному рынку;
 - 6) позиции клиринговых участников по рынку деривативов;
 - 7) переводит деньги, учитываемые на корреспондентских счетах Биржи, для обеспечения исполнения обязательств и обеспечения сделок с финансовыми инструментами

**Порядок передачи функционала по клиринговой и расчетной деятельности
и деятельности центрального контрагента от АО "Казахстанская фондовая биржа"
АО "Клиринговый центр KASE" по валютному рынку и рынку деривативов**

- клиринговых участников валютного рынка;
- 8) переводит деньги, учитываемые на корреспондентских счетах Биржи, для обеспечения исполнения обязательств и обеспечения сделок с финансовыми инструментами клиринговых участников рынка деривативов;
 - 9) переводит деньги, внесенные в клиринговый гарантийный фонд валютного рынка;
 - 10) переводит деньги, внесенные в клиринговый гарантийный фонд рынка деривативов.
12. Действия, указанные в подпунктах 1)–6) пункта 11 настоящего Порядка, оформляются актами приема-передачи между Клиринговым центром и Биржей.

Глава 3. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 13. Вопросы, не урегулированные настоящим Порядком, разрешаются в соответствии с законодательством Республики Казахстан, уставом Биржи, ее ВД, а также решениями органов и должностных лиц Биржи, принятыми в установленном порядке в пределах их компетенции.
- 14. Настоящий Порядок утрачивает силу после завершения передачи клиринговых счетов, учетных счетов, денег, являющихся маржевыми взносами и взносами в гарантийные фонды и подписания акта приема-передачи, указанного в пункте 12 настоящего Порядка.

Председатель Правления

Алдамберген А. Ө.

Приложение

к Порядку передачи функционала
по клиринговой и расчетной
деятельности и деятельности
центрального контрагента от
АО "Казахстанская фондовая
биржа" АО "Клиринговый центр
KASE" по валютному рынку
и рынку деривативов

РАСПОРЯЖЕНИЕ

на передачу денег, обязательств и требований и реквизитов банковских счетов

Настоящим _____ (полное наименование клирингового участника) поручает АО "Казахстанская фондовая биржа":

- 1) передать АО "Клиринговый центр KASE":
 - обязательства и/или требования, возникшие у клирингового участника по отношению к Бирже в результате заключения сделки (сделок) с финансовыми инструментами в торгово-клиринговой системе ASTS+ валютного рынка и в торгово-клиринговой системе Spectra рынка деривативов и учитываемое на клиринговом счете клирингового участника;
 - реквизиты банковских счетов клирингового участника в тенге и иностранных валютах, представленные в АО "Казахстанская фондовая биржа" в соответствии с Правилами осуществления расчетов по торгам иностранными валютами и Правилами осуществления расчетов по торгам на рынке деривативов.
- 2) перевести на корреспондентские счета АО "Клиринговый центр KASE" в Национальном Банке Республики Казахстан и банках-корреспондентах по иностранным валютам:
 - деньги, числящиеся на корреспондентских счетах Биржи в Национальном Банке Республики Казахстан и банках-корреспондентах по иностранным валютам для обеспечения исполнения обязательств и обеспечения сделок с финансовыми инструментами клиринговых участников валютного рынка и рынка деривативов;
 - деньги, числящиеся на корреспондентском счете Биржи в Национальном Банке Республики Казахстан и являющиеся взносами в гарантийные клиринговые фонды валютного рынка и рынка деривативов.

Передачу и перевод осуществить в конце рабочего дня, в котором Биржа последний день осуществляет деятельность центрального контрагента на валютном рынке и рынке деривативов.

Деньги, обязательства и требования передать в размере, определенном Биржей на конец рабочего дня, в котором Биржа последний день осуществляет деятельность центрального контрагента на валютном рынке и рынке деривативов.

Подписав настоящее распоряжение _____ (полное наименование клирингового участника) подтверждает, что ознакомлен с Порядком передачи функционала по клиринговой и расчетной деятельности и деятельности центрального контрагента от АО "Казахстанская фондовая биржа" АО "Клиринговый центр KASE" по валютному рынку и рынку деривативов, согласен с ним и обязуется исполнить условия Порядка в полном объеме.

[Должность первого руководителя]

[подпись]

[фамилия, инициалы]

Исполнитель: _____ (Ф. И. О.) _____ (тел.)