

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ИНСТРУКЦИЯ

**к порядку совершения сделок с акциями
представительского списка Индекса KASE
на фондовом рынке по схеме T+2**

(для пользователей торгового терминала KASE)

Введение

Для участия в торгах необходимо выполнить следующие предварительные действия:

- 1) подключиться к системе документооборота eTransfer, заключив соответствующий договор с ТОО "eTrade.kz", для получения документов от клирингового подразделения Биржи, ответственного за клиринг на фондовом рынке, и получить статус клирингового участника по категории "фондовый рынок" в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами¹ и Положением о клиринговых участниках²;
- 2) получить доступ к торгам, уплатив гарантийный взнос в размере 1 млн. тенге в гарантийный фонд АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа);
- 3) скачать и установить терминал торговой системы с функционалом T+2;
- 4) начать торговать на фондовом рынке, совершая сделки в соответствии с настоящей Инструкцией.

В течении переходного периода, устанавливаемого решением Правления Биржи, в торговом терминале KASE одновременно присутствуют два инструмента по акциям, входящим в представительский список Биржи (далее – акции индекса KASE): один для торгов по схеме расчетов T+2, другой для торгов по T+0 с гросс расчетами.

По завершению переходного периода по акциям индекса KASE будет отражаться один инструмент, расчеты по которому будут осуществляться только по схеме T+2.

Кодировка инструмента в секторе T+2: [краткое наименование акции]_T2.

Например: KZTO – инструмент T+0.

KZTO_T2 – инструмент T+2

Кодировка инструмента автоматического репо в секторе T+2: RN_[краткое наименование инструмента T+0].

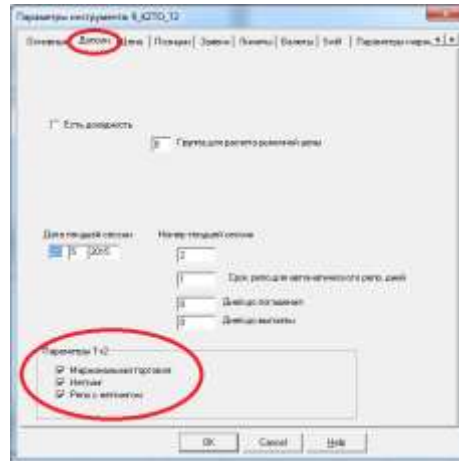
Например: R_KZTO_007 – инструмент T+0

RN_KZTO – инструмент T+2

Для того, чтобы посмотреть параметры T+2, необходимо выбрать инструмент, нажать по нему правой кнопкой мыши и в появившемся меню выбрать "Свойства". В открывшемся окне "Параметры инструмента" перейти на закладку "Дополнительно":

¹ Утверждены решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 14 мая 2012 года № 9).

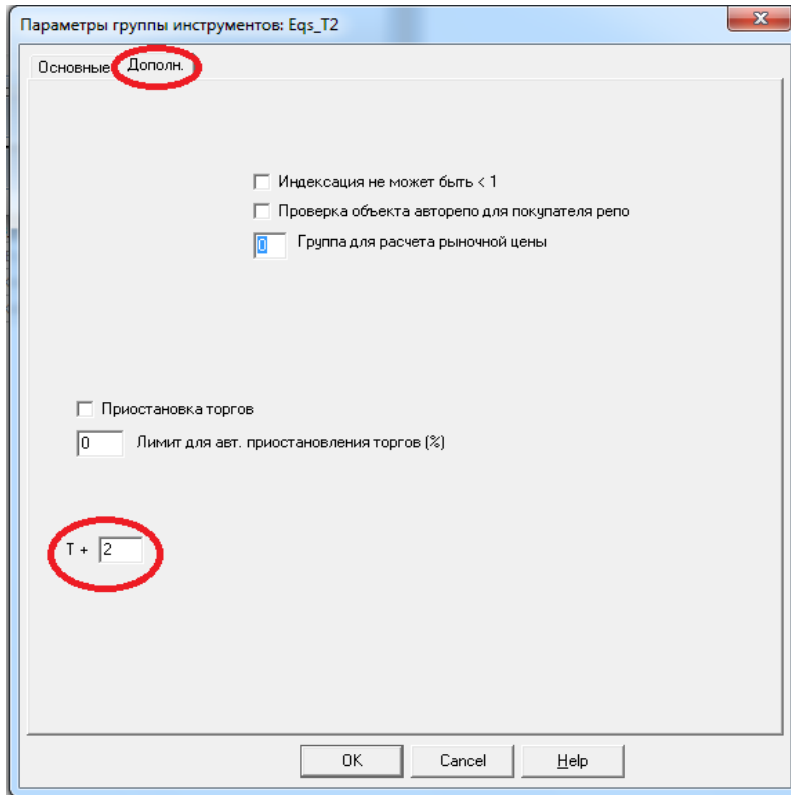
² Утверждено решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 08 апреля 2015 года № 7).



Доступны следующие параметры T+2:

- Маржинальная торговля. При активации данного элемента торги и расчеты проводятся с забором частичного обеспечения, в противном случае по схеме с полным преддепонированием денег и бумаг.
- Неттинг. Если данный элемент активен – сделки, заключенные по данному инструменту проходят клиринг и учитываются в расчетной ведомости по данному инструменту, формируемой в день заключения данных сделок. В противном случае сделки, заключенные по инструменту, не проходят клиринг и рассчитываются методом гросс-расчетов в день T+0.
- Репо с неттингом. Инструменты автоматического репо.. Предметы операций репо – акции Индекса. Обеспечение в сделках открытия – полное, в сделках закрытия – частичное.

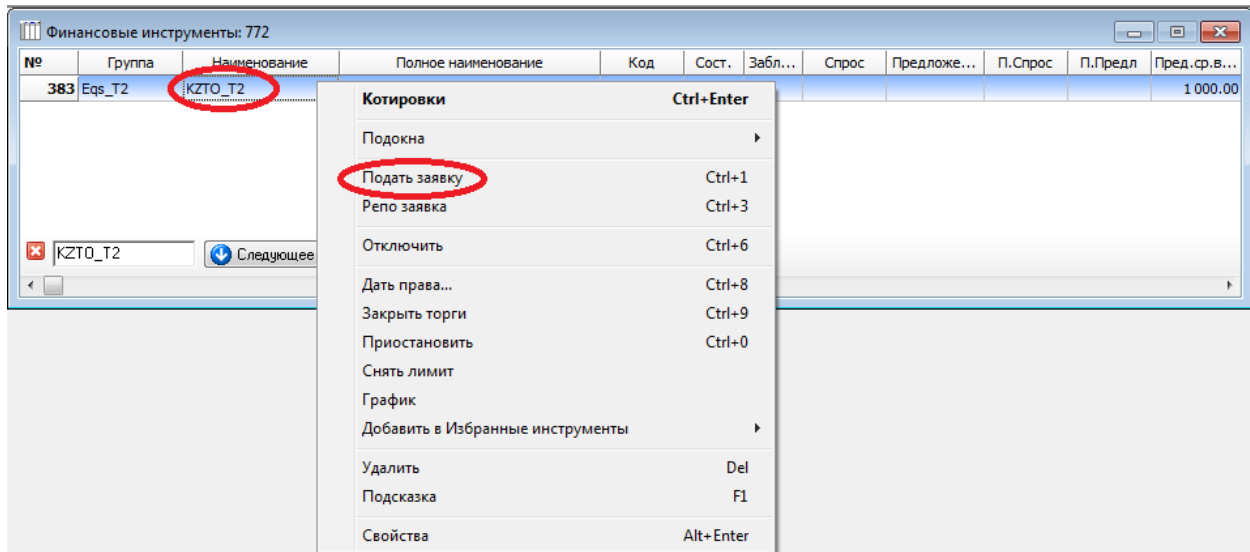
Для просмотра даты расчетов сделок по инструменту необходимо открыть окно групп инструментов (в главном меню: Просмотр > Структура рынка > Группы), выбрать необходимую группу, нажать по выбранной записи правой кнопкой мыши и в появившемся меню выбрать "Свойства". В открывшемся окне "Параметры группы инструментов" перейти на закладку "Дополнительно":



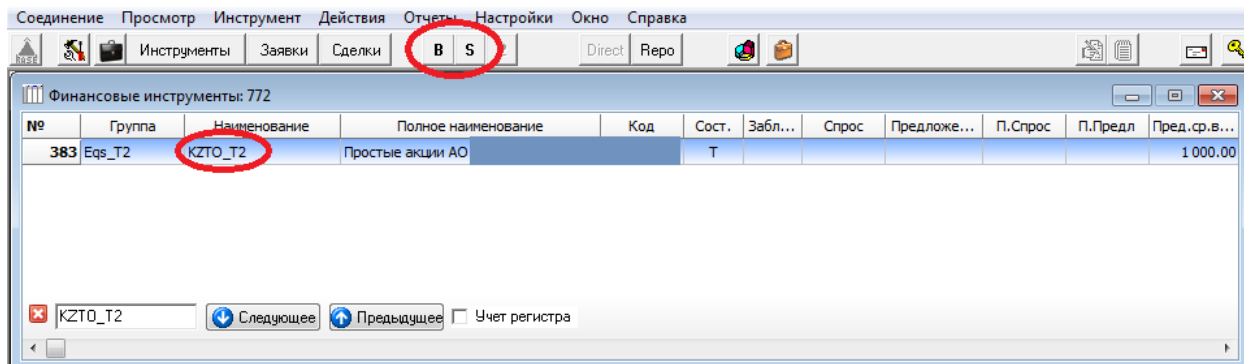
1. Подача заявки

Подать торговую заявку на заключение сделки купли-продажи в торговом терминале KASE можно следующими способами:

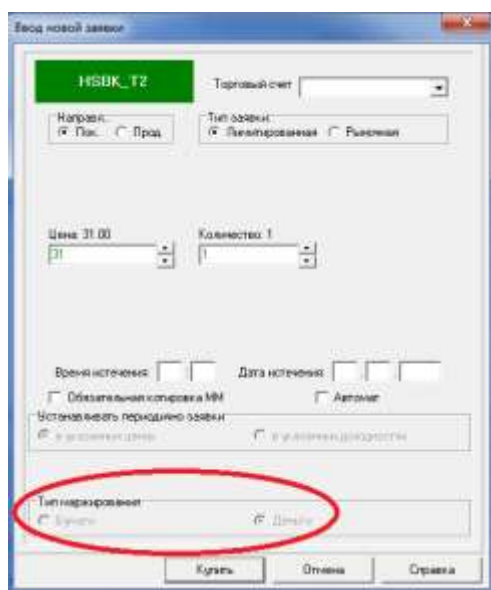
- выбрать необходимый инструмент в таблице "Финансовые инструменты", нажать по нему правой кнопкой мыши и в выпадающем окне выбрать "Подать заявку":



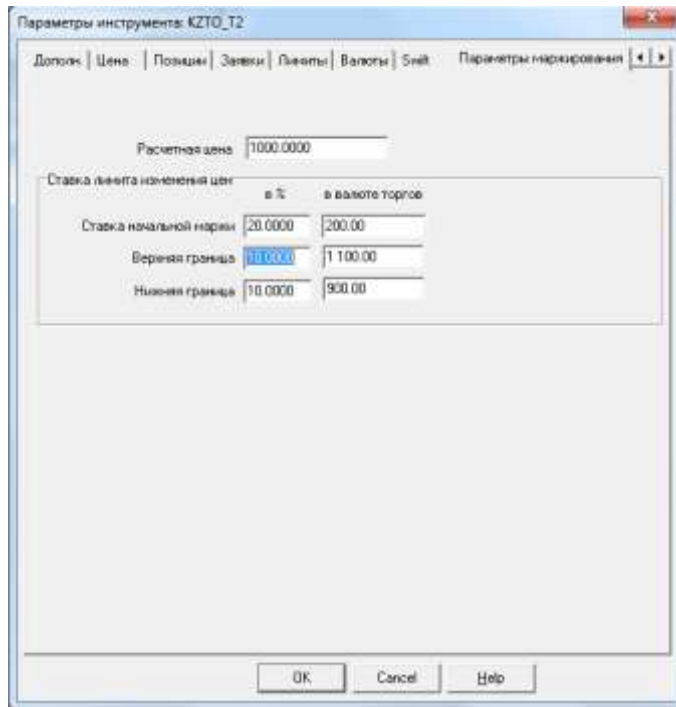
- выбрать необходимый инструмент в таблице "Финансовые инструменты" и нажать на кнопку "Купить" (обозначена буквой "B") или "Продать" (обозначена буквой "S") на панели инструментов терминала:



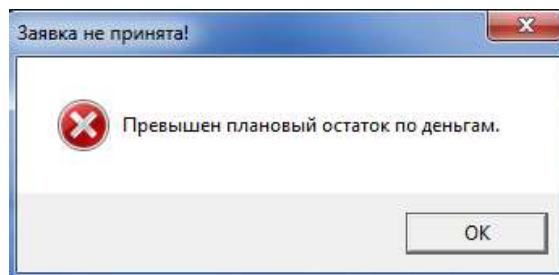
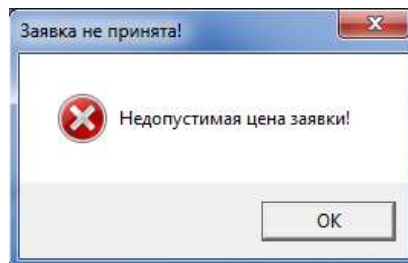
Заполнение заявки по инструментам с расчетами по схеме T+2 (далее – заявка по схеме T+2) происходит аналогично подаче заявки по инструментам с расчетами по схеме T+0.



Поданная заявка по схеме T+2 проверяется на лимит изменения цены и наличие маржевого обеспечения, рассчитанного с учетом ставок начальной маржи, которые отображаются во вкладке "Параметры маржирования" окна "Свойства" объекта типа "Инструмент":

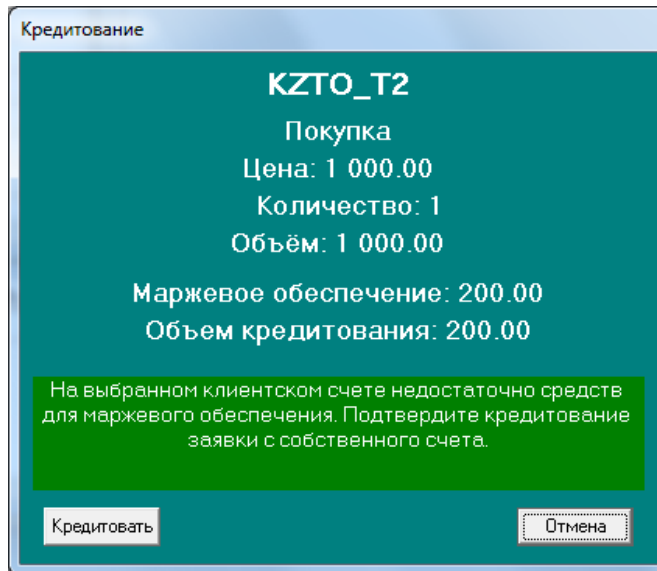


В случае успешной проверки заявка принимается торговой системой, в противном случае – отклоняется.

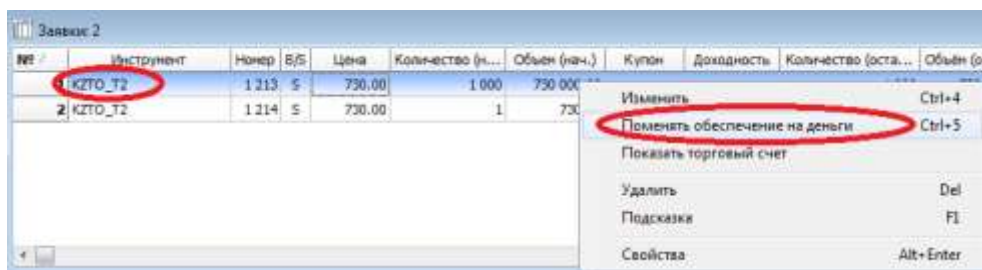
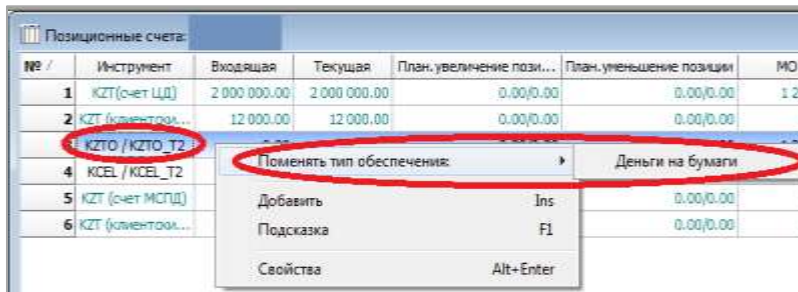


Сделка может быть обеспечена встречными нетто-требованиями.

При недостаточности денежного маржевого обеспечения на клиентском счете, недостающая часть маржи по решению брокера может быть заблокирована на собственном счете брокера в поле "Маржевое обеспечение (кредит)":



Изменить тип обеспечения по активным заявкам и заключенным сделкам (за исключением дня расчетов и заявок/сделок на покупку) можно на позиционном счете, выбрав пункт контекстного меню "Поменять тип обеспечения: [Бумаги на деньги/Деньги на бумаги]", либо по сделкам и заявкам, выбрав пункт контекстного меню "Поменять обеспечение на [деньги/бумаги]" :



1.1. Подача заявки по инструменту репо с неттингом

Подать заявку на заключение сделки на рынке репо с неттингом можно, выбрав необходимый инструмент в таблице "Финансовые инструменты". Способы подачи заявки аналогичны способам, указанным в пункте 1 настоящей Инструкции.

Форма подачи заявки представлена ниже:

Расчет цен открытия, закрытия и сумм сделок по ним осуществляется аналогично расчетам прямого репо. "Репо-обязательство" не создается. Встречные заявки образуют сразу сделку открытия и сделку закрытия с соответствующими датами расчетов.

Сделка открытия должна быть полностью обеспечена либо активами, либо встречными нетто-требованиями, день расчетов по которым совпадает с днем расчетов по данной сделке открытия. При этом если только часть сделки открытия обеспечивается встречными требованиями, тогда оставшаяся часть обеспечивается активом в полном размере (100%).

По сделке закрытия забирается маржевое обеспечение в соответствии с параметрами инструмента, являющегося предметом репо. При этом в заявках/сделках на продажу тип маржи по умолчанию – деньги.

2. Заключение сделки

Сделки с расчетами T+2 по умолчанию формируются в статусе **"Wait for Clearing"**. Сделка открытия репо формируется сразу в статусе "Waits for CD".

В случае использования торговых счетов Системы подтверждения такие сделки формируются в статусе **"Waits for Confirm"** ("**Waits for Partner**", для контрагента, работающего без системы подтверждения).

Если кастодиан согласен с параметрами сделки, заключенной брокером по его торговому счету, то он проставляет по сделке статус **"Confirmed"** – сделка переводится в статус **"Wait for Clearing"**, в противном случае кастодиан отвергает сделку, выставляя статус **"Rejected by Investor"**.

Сделки, по которым кастодианом не было выполнено никаких действий, по команде в расписании автоматически подтверждаются.

Брокер имеет возможность изменить торговый счет в сделке со статусом **"Rejected by Investor"**. Если новый измененный торговый счет также контролируется системой подтверждения, то сделка снова переходит в статус **"Waits for Confirm"**, если счет без системы подтверждения – в **"Wait for Clearing"**. При смене счета производится разблокировка забранного обеспечения (маржевого или полного) на старом торговом счете и соответствующая блокировка на новом.

По отвергнутой кастодианом сделке брокер имеет возможность сделать запрос на расторжение сделки путем выставление статуса **"Wait for Cancellation"**.

При переводе сделки в статус **"Wait for Cancellation"** контрагент получает сообщение об имеющихся у него возможностях: 1) расторгнуть сделку (перевести в статус **"Cancelled"**) 2) сообщить о готовности исполнить сделку (перевести в статус **"Rejected by Investor"**).

При переводе сделки в статус **"Cancelled"** блокировка обеспечения по ней с обеих сторон снимается.

Пример заключения сделок на рынке акций по новой (T+2) схеме приведен в Приложении 1.

Пример изменения позиционных счетов по заявке/сделке репо приведен в Приложении 2.

3. Подтверждение позиций

По позиционным счетам, образованным сделками по торговым счетам системы подтверждения, кастодиан обязан дать расчетное подтверждение. В случае непредоставления подтверждения, позиции подтверждаются торговой системой автоматически по расписанию. Эта операция реализуется в торговом терминале KASE путем выбора пункта **"Подтвердить позицию"** в контекстном меню по позиционному счету. По умолчанию позиция находится в статусе **"Ожидает подтверждения"**. При выборе пункта **"Подтвердить позицию"** позиционный счет переходит в статус **"Позиция подтверждена"**. Все сделки, образовавшие подтвержденную позицию, переводятся в статус **"Waits for CD"**.

В случае несогласия, кастоди выбирает пункт **"Отклонить позицию"**. При этом изменений в забранном обеспечении не производится, а сделки, образовавшие данную позицию, переходят в статус **"Rejected by Investor"**.

По позиционным счетам, образованным сделками по торговым счетам без системы подтверждения, процедура подтверждения позиций производится автоматически по расписанию.

Пример изменения обязательств при подтверждении позиций приведен в Приложении 3.

4. Клиринговая отчетность

Отчетность, формируемая в результате клиринговой сессии, предоставляется участникам торгов в виде PDF-файлов.

Каждому клиринговому участнику предоставляется 3 отчета:

- Итоговая ведомость по нетто-позициям на фондовом рынке (в разрезе торговых счетов)
- Детализированный отчет по нетто-позициям (по каждому торговому счету, в разрезе позиций)
- Отчет о неисполненных обязательствах (пустая таблица, если участник исполняет все обязательства)

Макеты предоставляемых отчетов приведены в Приложении 4.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1. Пример изменения позиций при подаче заявки и её удовлетворении. Случай нетто расчетов

Параметры инструмента KZTO_T2 - ставка маржи 20 %, расчетная цена 900.

Исходное состояние счетов:

Счет покупателя: 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1500	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0

Счет продавца: 0002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача заявки на покупку по KZTO_T2 – цена 1000, количество 2, счет 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	0 / -2000	360	0	0	1140	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 2	0 / 0	360	0	0	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача встречной заявки со счета 0002 (по умолчанию маржа в виде бумаг)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 2000	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / -2	0	0	2	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	1140	0	0	-2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	0	2	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	0	0	-2	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000

ПРИЛОЖЕНИЕ 2. Пример изменения позиций при подаче нового типа репо заявки и её удовлетворении. Случай полного покрытия по сделке открытия.

Параметры инструмента KZTO_T2 - ставка маржи 20 %, расчетная цена 900.

Исходное состояние счетов:

Счет покупателя репо (покупатель инструмента предмета репо): 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2500	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0

Счет продавца репо (владелец актива): 002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача заявки на покупку RN_KZTO_001 – цена -5 (в процентах годовых), количество 2, счет 0001, рыночная цена равна расчетной

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 1799.75	0 / -1800	360	0	1800	340	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 2	0 / -2	360	0	1800	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 2	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача встречной заявки со счета 002 (по умолчанию маржа в виде бумаг)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 1800	0 / -1799.75	360	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 2	0 / -2	360	0	2	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / -2	-	-	-	-2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 0	0 / 0	360	0	1800	340	-1800	1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1800	0 / 1799.75
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	1800	0	2	-2	0	0 / 0	0 / 2	0 / 2	0 / 1800	0 / 1799.75
R_KZTO_001_T	0	2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 1800	0 / 0

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	360	0	0	1000	1800	-1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1799.75	0 / 1800
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	2	0	0 / 0	0 / 2	0 / 2	0 / 1799.75	0 / 1800
R_KZTO_001_T	0	-2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	-2	0	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 1800

ПРИЛОЖЕНИЕ 3. Пример изменения обязательств при подтверждении позиций

По инструменту KZTO_T2 была заключена сделка (день T). Больше никаких активных действий в последующие дни данными участниками не производилось.

Расчетная цена равна 900 тг. и далее не меняется, ставка маржевого обеспечения равна 20% и далее не меняется.

счет покупателя 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	0	0	-2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	0	2	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0	Ожидает подтверждения

и продавца 0002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	0	0	-2	0 / -2	0 /	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Ожидает подтверждения

Состояние счетов на день T+1:

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	0	-2000	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	2	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0	Ожидает подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	2000	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	0	-2	0	0 / -2	0 /	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Ожидает подтверждения

Состояние счетов на день T+2 (утро)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	-2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	2	0	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0	Ожидает подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	0	0	0 / -2	0 /	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Ожидает подтверждения

Покупатель заключил сделку репо с неттингом (покупка бумаг) на 1 шт с неким продавцом (не представлен в таблице). Цена открытия 900 тг., цена закрытия 899 тг.

Обеспечение по сделке открытия репо забрано в поле Блок (Т+2) в размере 900, маржа по сделке закрытия репо добавилась в поле МО: 360 + 180 = 540

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТОП	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	540	0	900	2060	-2900	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 899	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	540	0	0	0	3	-1	0	0 / 2	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 899	Ожидает подтверждения
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Участником (в случае СПС) либо автоматически (в случае не СПС) по позициям проставляется статус "Подтверждена".

По позиции KZTO осталось забрано маржевое обеспечение под сделку закрытия репо в размере 180. Маржевое обеспечение под ранее заключенную сделку с расчетами сегодня освободилось, а вместо него забралось 100% обеспечения (+ 2000) в поле "Блок (Т+2)".

Состояние счетов на день Т+2: после подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТОП	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	180	0	2900	420	-2900	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	180	0	0	0	3	-1	0	0 / 2	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 899	Подтверждена
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТОП	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	2000	899	0	0 / -	- / -	- / -	- / -	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Подтверждена

Состояние счетов на день Т+2: после расчетов нетто-ведомости – обновилась поля Текущая, Т0, Т1, Т2, Блок(Т+2), Нетто/СумТОП.

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТОП	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	600	0 / 0	0 / 0	180	0	0	420	0	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	3	0 / 0	0 / 0	0	0	0	0	0	-1	0	0 / -1	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 0	Подтверждена
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТОП	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	3000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	3000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	- / -	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	0	0 / 0	0 / 0	0	0	0	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Подтверждена

ПРИЛОЖЕНИЕ 4. Макеты клиринговых отчетов

ИТОГОВАЯ ВЕДОМОСТЬ
по нетто-позициям на фондовом рынке
№ T2_[дата]_[идентификационный номер клирингового участника]

Клиринговый участник: [полное наименование клирингового участника]

Дата формирования: [текущая дата T0 в формате ДД.ММ.ГГГГ]

Рынок: Фондовый

Торговый счет XXXXX00000

Дата расчетов [T0]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заемные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXX00000	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
Итого:					XXX								

Дата расчетов [T0+1]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заемные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXX00000	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X

]				
Итого:						XXX							

Дата расчетов [T0+2]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заёмные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXXX00000	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
Итого:						XXX							

Торговый счет XXXXXXXXXXXX

Дата расчетов [T0]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заёмные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXXXXXXX	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
Итого:						XXX							

Дата расчетов [T0+1]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заёмные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXXXXXXX X	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
Итого:					XXX								

Дата расчетов [T0+2]

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Текущая открытая позиция	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем-нетто (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)	В блоке (шт.)	Клиринговые сборы	Заёмные средства
1	2		3	4	5	6	7	8	9	10	11	11	
XXXXXXXXXX X	KZT	XXX	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	NIN#1	XXX	XXX	-X	+X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
	NIN#2	XXX	XXX	-X	X	XXX	XX	X	[KZT/STOCK]	X	X	X	X
Итого:					XXX								

... (продолжение по всем торговым счетам)

ДЕТАЛИЗИРОВАННЫЙ ОТЧЕТ

по нетто-позициям

№ TD2_[дата]_[идентификационный номер клирингового участника]

по счету XXXXXXXXXXXX

Дата: [текущая дата в формате ДД.ММ.ГГГГ]

Рынок: Фондовый

Входящая денежная позиция: XXXXX тг.

Нетто-позиция

по инструменту: [НИН ФИ] NIN#1

Входящая позиция: XXX шт.

Дата расчетов [T0]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10
NIN#1	X XXX XX	-XX		+XX	XX	XX	[KZT/STOCK]	XX
	X XXX XX		+XX	- XX			[KZT/STOCK]	XX
Итого:	-							

Дата расчетов [T0+1]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10
NIN#1	X XXX XX	-XX		+XX	XX	XX	[KZT/STOCK]	XX

	X XXX XX		+XX	- XX			[KZT/STOCK]	XX
Итого:	-							

Дата расчетов [T0+2]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10
NIN#1	2 155 001	-20		+6240	20	300	KZT	1200
	2 155 099		+10	- 3120			KZT	600
Итого:	-							

по инструменту: [НИН ФИ] NIN#2

Входящая позиция: XXX шт.

Дата расчетов [T0]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10
NIN#2	X XXX XX	-XX		+XX	XX	XX	[KZT/STOCK]	XX
	X XXX XX		+XX	- XX			[KZT/STOCK]	XX
Итого:	-							

Дата расчетов [T0+1]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10

NIN#2	X XXX XX	-XX		+XX	XX	XX	[KZT/STOCK]	XX
	X XXX XX		+XX	- XX			[KZT/STOCK]	XX
Итого:	-							

Дата расчетов [T0+2]

НИН ФИ	Сделка (номер)	Продажа (шт.)	Покупка (шт.)	Объем (KZT)	Ставка маржи (в %)	Расчетная цена	Тип обеспечения	Маржа (KZT)
1	2	4	5	6	7	8	9	10
NIN#2	2 155 001	-20		+6240	20	300	KZT	1200
	2 155 099		+10	- 3120			KZT	600
Итого:	-							

... (продолжение по всем позициям)

О Т Ч Е Т

о неисполненных обязательствах

№ RD2_(дата)_(идентификационный номер клирингового участника)

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Обязательства по позиции	Обязательства по марже
1	2		3	6
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX	XX
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX	XX
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX	XX

О Т Ч Е Т

о разбиении неисполненных обязательств по

№ DF2_(дата)_(идентификационный номер клирингового участника)

Торговый счет	НИН ФИ	Входящая позиция	Обязательства по позиции	Требования по позиции	Поставляемая часть		Отложенная часть	
					обязательства	требования	обязательства	требования
1	2		3	4				
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX					
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX					
XXXXXXXX	[KZT NIN]	XX	XX					