

**У т в е р ж д е н ы**

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
Басқармасының шешімімен

(2020 жылдың 24 қарашасындағы  
№ 155 отырыс хаттамасы)

2020 жылдың 30 қарашасынан бастап

**қолданысқа енгізілді**

# Валюта нарығындағы клирингілік есептердің ФОРМАТТАРЫ

## **ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ**

### **1. № 1 өзгерту:**

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен (2020 жылдың 15 желтоқсанындағы № 164 отырыс хаттамасы) бекітілген;
- 2020 жылдың 20 желтоқсанынан бастап қолданысқа енгізілген.

Осы Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары (бұдан әрі – Форматтар) клирингілік қызметті жүзеге асыруды реттейтін "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) ішкі құжаттарына сәйкес әзірленді және клирингілік қатысушыларға ұсынылатын есептердің нысандары мен форматтарын сипаттайды.

1. Осы Форматтарда Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның басқа да ішкі құжаттарында анықталған ұғымдар мен терминдер пайдаланылады.
2. Валюта нарығының клирингілік есептері Биржаның "Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті" ішкі құжатында белгіленген тәртіппен клирингілік жүйеде қалыптастырылады және клирингілік қатысушыларға электрондық құжаттар алмасу жүйесі eTransfer.kz <sup>1</sup> арқылы жіберіледі.
3. Қор нарығының клирингілік есептері XML (1, 2, 3, 4, 5, 6 қосымшалары) және PDF (7 қосымша) форматында қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады.
4. XML форматындағы қор нарығының әрбір клирингілік есебінде мәтіндік жолдар түріндегі тақырып және деректері бар жолдар болып табылатын мазмұндық бөлік бар.
5. XML форматындағы қор нарығының әрбір клирингілік есебі келесідей түрлендірілуі мүмкін:  
алушыға ыңғайлы кез келген формат (оның ішінде бөлгіштері бар TXT форматы) өзінің бэк-офистік бағдарламалық құралдарымен және/немесе стандартты бағдарламалық құралдармен (MS Excel) өңдеу жолымен;  
Microsoft Internet Explorer-де файлды ашу арқылы баспа түрінде.

---

<sup>1</sup> Берілетін деректердің құпиялылығы мен түзетілмейтіндігін қамтамасыз ететін кепілдік берілген жеткізумен және криптографиялық қорғау құралдарымен Биржа мен клирингілік қатысушы арасындағы электрондық құжат айналымының мамандандырылған жүйесі.

**Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
TNT*		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қай күнге жасалатын күн	+	dateTime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп қалыптастырылған, есеп айырысу клирингілік сессияның реттік нөмірі	+	integer		
		2 – CNY бойынша есеп айырысуға арналған клирингілік сессия				
		3 – Өтімділік провайдерлерімен есеп айырысуға арналған клирингілік сессия CNY				
		4 – T0 бойынша есеп айырысуға арналған негізгі клирингілік сессия				
		5 – қосымша клирингілік сессия				
		6 – жосықсыз клирингілік қатысушылармен клирингілік сессия				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендіргіші	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
GROUP		Сауда-саттық коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
CURRENCY						
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының сәйкестендіргіші	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	2
SETTLE						
	DEBIT	Жартылай қамтамасыз етілген мәмілелер бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2

**Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары**

<b>Ноданың атауы</b>	<b>Атрибуттың атауы</b>	<b>Сипаттамасы</b>	<b>Міндеттілігі</b>	<b>Тұрпаты</b>	<b>Көлемі</b>	<b>Ондық таңбалар</b>
	CREDIT	Жартылай қамтамасыз етілген мәмілелер бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO	Жартылай қамтамасыз етілген мәмілелер бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT						
/KASE_DOC						

\* TNT\_ – есеп айырысу клирингілік сессия үшін есепті кодтау.

(Осы қосымша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 15 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілген)

**Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы**

**Қ О Р Ы Т Ы Н Д Ы Е С Е П**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
TNTFINx		Есеп деректерінің блогы				
	TODAYDATE	Қай күнге есеп жасалатын, дата	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендіргіші	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша деректер блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының сәйкестендіргіші	+	string	4	
SETTLE		Мәмілелер бойынша есептесу міндеттемелер / талаптар бойынша деректер блогы				
	NETTO_FOREX	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстерінің мәмілелері бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_VARMARGIN	Вариациялық маржа бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Қорытынды нетто-талап немесе нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2

Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNTFINfx						
/KASE_DOC						

**Есеп айырысу күні келмеген мәмілелер бойынша  
нетто-талаптар / нетто міндеттемелер туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
TNFfx*		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендіргіші	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADEDATE	Есеп айырысу күні	+	datetime		
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингілік қатысушының жайғасымдары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	"CASH" болса – онда енгізілген нодаларда ақша жайғасымы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат бар, егер "SECURITY" – қаржы құралдары бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша деректер блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының сәйкестендіргіші	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Қаржы құралдары бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	+	string	12	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша деректер блогы/				



Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
	CREDIT_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстерінің мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстерінің мәмілелері бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_DEF	Реттеу мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_DEF	Реттеу мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_DEF	Реттеу мәмілелері бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Қорытынды нетто-талап немесе нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNFfx						
/KASE_DOC						

\* TNFfx – есеп айырысу клирингілік сессия үшін болашақ нетто туралы есепті кодтау.

**Margin-call туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
MRCfx		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Қай күнге есеп жасалатын, дата	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендіргіші	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда-саттық коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Маржалық талап сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						
/MRCfx						
/KASE_DOC						

\*MRCfx – margin-call есебін кодтау.

**Клирингке кірген мәмілелер бойынша**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element).				
CNTfx		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Бас фирманың идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық тәртіптемесі бойынша деректер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық тәртіптемесіні сәйкестендіргіші	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық тәртіптемесінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Валюта бойынша деректер блогы расчeтов				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының сәйкестендіргіші	+	string	4	
SECURITY		Қаржы құралы бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	
RECORDS		Мәміле бойынша деректер блогы				
	TRADE_NO	ASTS+ сауда-клирингілік жүйесіндегі мәміленің нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		
	BUY_SELL	Мәміленің / мәміленің бір бөлігінің бағыты (сатып алу (B) / сату (S))	+	string	1	

Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
	PRICE	Мәміле бағамы. Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары үшін ашу мәмілесінің немесе жабу мәмілесінің бағасы.	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Қаржы құралдарының санымен мәміле көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Ақша, есеп айырысу валютасымен мәміле көлемі	+	decimal	20	2
SETTLE		Есеп айырысулар бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Нақты есеп айырысу күні	+	date		
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNTfx						
KASE_DOC						

\* CNTfx – нетто негізде клирингке кірген мәмілелер бойынша есепті кодтау.

**Вариациялық маржаны төлеу бойынша міндеттемелер/ талаптар туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
VMR		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Қай күнге есеп жасалатын, дата	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендіргіші	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда-саттық коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
SECURITY		Қаржы құралы бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының сәйкестендіргіші	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	
SETTLEDATE		Орындау күні бойынша деректер блогы				
	SETTLEDATE	Орындау күні	+	dateTime		
RECORDS		Міндеттемелер бойынша деректер блогы / валюта нарығының туынды қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша талаптар				
	PREVIOUS_SETTLE_PRICE	Алдыңғы есеп айырысу бағасы (алдыңғы сауда-саттық күнінен бұрын жасалған мәмілелер үшін) / мәміле бағасы (алдыңғы сауда-саттық күнінде жасалған мәмілелер үшін)		number	20	6
	PREVIOUS_QUANTITY	Алдыңғы сауда-саттық күніндегі базалық активтің саны		number	20	2
	PREVIOUS_TRADE_VOLUME	Алдыңғы сауда-саттық күніндегі мәміле көлемі		number	20	2
	CURRENT_SETTLE_PRICE	Мәміленің ағымдағы есептесу бағасы		number	20	6

Валюта нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
	CURRENT_QUANTITY	Ағымдағы сауда-саттық күніндегі базалық активтің саны		number	20	2
	CURRENT_TRADE_VOLUME	Ағымдағы сауда-саттық күніндегі мәміле көлемі		number	20	2
	VARIATION_MARGIN	Вариациялық маржаны төлеу бойынша міндеттеме / талап (белгісімен көрсетіледі)		number	20	2
/RECORDS						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/SETTLE						
/FIRM						
/VMR						
/KASE_DOC						

\* VMR – вариациялық маржаны төлеу бойынша міндеттемелер / талаптар туралы есепті кодтау.

## Клирингілік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы ЕСЕП

Есеп беру күні: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының атауы: \_\_\_\_\_

Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды: \_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының клирингілік кепілдік қоры бойынша талаптары мен міндеттемелерін есептеу	Сома, теңге
Кепілдік жарнаның қажетті мөлшері	
Сауда-саттық басталғанға дейінгі кепілдік жарнаның мөлшері	
Клирингілік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін өтеу үшін кепілдік жарнадан Биржа пайдаланған сома	
Дәрменсіз клирингілік қатысушылардың міндеттемелерін жабу үшін кепілдік жарнадан Биржа пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша кепілдік жарнаның мөлшері	
Кепілдік жарна бойынша міндеттемелер / талаптар: '+' – міндеттемелер '-' – талаптар	

**Клирингілік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі көрсетілген күнге дейін орындалуы тиіс:**

\_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының клирингілік сақтық қор бойынша міндеттемелерін есептеу	сома, теңге
Клирингілік сақтық қордың сауда-саттық басталғанға дейінгі мөлшері	
Клирингілік қатысушының меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингілік сақтық қордан Биржа пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингілік сақтық қордың мөлшері	
Клирингілік сақтық қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

**Клирингілік қатысушының клирингілік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі көрсетілген күнге дейін орындалуы тиіс:**

\_\_\_\_\_