

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 29 ноября 2019 года № 147)

Введен в действие

с 03 декабря 2019 года

РЕГЛАМЕНТ

проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 18 июня 2020 года)

г. Алматы

2019 год

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения и дополнения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 18 июня 2020 года № 84);
- введены в действие с 03 августа 2020 года.

2. Изменение № 2:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 17 ноября 2020 года № 151);
- введено в действие с 30 ноября 2020 года.

3. Изменение № 3:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 01 июля 2021 года № 65);
- введено в действие с 07 июля 2021 года.

4. Изменения № 4:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 29 июля 2022 года № 92);
- введены в действие с 22 августа 2022 года.

5. Изменение № 5:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 20 сентября 2022 года № 109);
- введено в действие с 20 сентября 2022 года.

6. Изменение № 6:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 07 декабря 2022 года № 142);
- введено в действие с 07 декабря 2022 года.

Настоящий Регламент определяет временной порядок осуществления АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами на биржевых рынках, исполняя функции центрального контрагента.

1. Понятия, используемые в настоящем Регламенте, идентичны понятиям, которые определены внутренним документом Биржи "Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами" и иными внутренними документами Биржи.
2. Настоящий Регламент определяет время проведения процедур, проводимых Биржей в рамках осуществления клиринговой деятельности на биржевых рынках по сделкам с которыми Биржа исполняет функции центрального контрагента.
3. Клиринговый день, в течение которого Биржей осуществляются все необходимые процедуры по клиринговой деятельности, начинается в 08.00 ALT и заканчивается в 23.59 ALT (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 29 июля 2022 года*).
4. Время осуществления Биржей клиринговой деятельности по сделкам с которыми Биржа исполняет функции центрального контрагента на определенных биржевых рынках установлено приложениями к настоящему Регламенту.
5. Время проведения клиринговых сессий может быть изменено заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим клиринговое подразделение, или лицом, исполняющим его обязанности, в случаях сбоя в работе программно-технических средств, которые используются при проведении клиринговых сессий, выявления обстоятельств, препятствующих проведению клиринговых сессий в обычном режиме, или иных обстоятельств.
6. В случае возникновения задержки в проведении клиринговых сессий на каком-либо этапе, время начала следующего этапа сдвигается на время, не превышающее времени возникшей задержки.
7. Ответственность за своевременное внесение изменений и дополнений в настоящий Регламент несет клиринговое подразделение.
8. Настоящий Регламент подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

Председатель Правления

Алдамберген А.Ө.

Приложение 1

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

(Данное приложение изменено решениями Правления Биржи от 18 июня 2020 года, от 29 июля 2022 года, от 20 сентября 2022 года и от 07 декабря 2022 года)

РЕГЛАМЕНТ
расчетно-клиринговых сессий на фондовом рынке

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
A	1	2
1.	10:00 – 10:30	Клиринговая сессия mark-to-market
2.		Определение маржинальных требований
3.		Возврат выплат по купонам и дивидендам по сделкам репо и сделкам купли/продажи Y_n^1
4.		Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: – информацию о margin-call – информацию об обязательствах по передаче / требованиям по получению дохода – информацию об имуществе, внесенном в имущественные пулы.
5.	15:30 – 17:30	Первая расчетно-клиринговая сессия
6.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT
7.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT
8.	16:00	Крайнее время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет KASE в Центральном депозитарии, ценных бумаг – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 16:00 ALT
9.		Урегулирование неисполненных нетто-обязательств клиринговых участников по сделкам с частичным обеспечением с наступившей

¹ По сделкам с частичным обеспечением и датой расчетов отличной от даты заключения сделки.

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
		датой исполнения, заключенным до 16:00 ALT
10.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с полным покрытием, заключенным до 16:35 ALT
11.		Проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии
12		<p>В случае отказа расчетов по приказу на регистрацию нетто-операций дополнительно производится:</p> <p>Урегулирование дефолта нетто-обязательств участников в связи с отказом в расчетах приказа на регистрацию нетто-операций;</p> <p>Проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии с учетом сделок урегулирования дефолта нетто-обязательств</p>
13		Предоставление клиринговым участникам отчетов об итоговых нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам первой расчетной клиринговой сессии
14	17:30 – 19:15	Вторая расчетно-клиринговая сессия
15		Определение итоговых нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT
16		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT
17	17:45	Крайнее время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет KASE в Центральном депозитари, ценных бумаг – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 17:45 ALT
18		Урегулирование неисполненных нетто-обязательств клиринговых участников по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 17:45 ALT
19		Проведение расчетов по сделкам второй расчетной клиринговой сессии
20		<p>В случае отказа расчетов приказа на регистрацию нетто-операций дополнительно производится:</p> <p>Урегулирование дефолта нетто-обязательств участников в связи с отказом в расчетах приказа на регистрацию нетто-операций;</p> <p>Проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии с учетом сделок урегулирования дефолта нетто-обязательств.</p>
21		<p>Предоставление клиринговым участникам отчетов:</p> <ul style="list-style-type: none"> – об итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях по сделкам второй расчетной клиринговой сессии; – о нетто-обязательствах / нетто-требованиях по сделкам с будущими датами расчетов;

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
		– о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам.

Приложение 2
к Регламенту проведения
клиринговых сессий по
сделкам с центральным
контрагентом

*(Данное приложение изменено решениями Правления Биржи от 18 июня 2020 года
и от 17 ноября 2020 года)*

РЕГЛАМЕНТ
расчетно-клиринговых сессий на валютном рынке

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
A	1	2
1.	09:00-09:30	Клиринговая сессия mark-to-market
2.		Определение маржинальных требований по сделкам с не наступившими датами исполнения
3.		Определение обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи
4.		Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: – информацию о margin-call; – информацию об обязательствах по уплате / требований по получению вариационной маржи
5.	12:00 – 12:30	Утренняя клиринговая сессия для расчетов по CNY
6.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
7.		Проведение расчетов по сделкам в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
8.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
9.	13:00	Крайнее время поставки Бирже клиринговыми участниками китайских юаней в оплату нетто-обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения
10.	13:30-13:45	Клиринговая сессия по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням
11.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням, заключенным с 13:00 до 13:30 ALT
12.		Проведение расчетов по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням
13.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням
14.	15:30 – 16:00	Основная клиринговая сессия для расчетов по T0

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
A	1	2
15.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
16.		Проведение расчетов по сделкам в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
17.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
18.	17:00	Крайнее время поставки Бирже клиринговыми участниками казахстанских тенге, долларов США, евро, российских рублей в оплату нетто-обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения
19.	17:30 – 18:00	Дополнительная клиринговая сессия
20.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
21.		Проведение расчетов в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
22.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
23.	19:00-19:30	Клиринговая сессия с недобросовестными клиринговыми участниками
24.		Урегулирование неисполненных итоговых нетто-обязательств клиринговых участников в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях, китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
25.		Заключение сделок переноса неисполненных позиций на следующий рабочий день

Приложение 3

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

(Данное приложение изменено решениями Правления Биржи от 18 июня 2020 года и от 01 июля 2021 года)

**РЕГЛАМЕНТ
клиринговой сессии на рынке деривативов**

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
A	1	2
1.	13:00	Крайнее время поставки клиринговыми участниками денег для исполнения итоговых нетто-обязательств по вариационной марже
2.	13:00 – 17:30	Урегулирование неисполненных итоговых нетто-обязательств клиринговых участников по margin call
3.	17:30 – 18:00	Промежуточная клиринговая сессия
4.		Определение промежуточных нетто-требований / нетто-обязательств клиринговых участников по заключенным сделкам по каждому расчетному коду / агрегированному торгово-клиринговому счету / сегрегированному торгово-клиринговому счету
5.		Расчет гарантийного обеспечения
6.		Расчет торгового лимита
7.	20:30 – 21:00	Финальная клиринговая сессия
8.		Определение итоговых нетто-требований / нетто-обязательств клиринговых участников по заключенным сделкам по каждому расчетному коду / агрегированному торгово-клиринговому счету / сегрегированному торгово-клиринговому счету
9.		Расчет гарантийного обеспечения
10.		Расчет торгового лимита
11.		Фиксация margin-call
12.	до 00:00	Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: <ul style="list-style-type: none"> – о позициях, учитываемых на торгово-клиринговых счетах; – об итоговых обязательствах по уплате / требований по получению вариационной маржи; – информацию о margin-call