

"KASE КЛИРИНГ ОРТАЛЫҒЫ" АҚ

"KASE клиринг орталығы" АҚ Басқармасының
шешімімен

(отырыстың
2023 жылғы 01 шілдедегі № 17 хаттамасы)

бекітілген

2023 жылғы 21 шілдеден бастап¹

қолданысқа енгізілді

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингілік сессиялар өткізу

РЕГЛАМЕНТІ

Алматы қ.

2023 жыл

¹ "KASE клиринг орталығы" АҚ қызметі басталған күннен бастап

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. №1 өзгерістер:

- "KASE клиринг орталығы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілді (отырыстың 2024 жылғы 23 ақпандағы № 12 хаттамасы);
- 2024 жылғы 01 наурыздан бастап қолданысқа енгізілді.

2. №2 өзгерістер:

- "KASE клиринг орталығы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілді (отырыстың 2024 жылғы 14 тамыздағы № 54 хаттамасы);
- 2024 жылғы 14 тамыздан бастап қолданысқа енгізілді.

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті (бұдан әрі – Регламент) орталық контрагенттің функцияларын орындай отырып, "Қазақстан қор биржасы" АҚ өткізетін сауда-саттықтарда айналысқа жіберілген қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша "KASE клиринг орталығы" АҚ (бұдан әрі - Клиринг орталығы) клирингілік қызметті жүзеге асыру тәртібін айқындайды. Орталық контрагент, сондай-ақ клиринг қатысушыларына ұсынылатын есептердің нысандары мен форматтарын сипаттайды.

1-бап. Жалпы ережелер

1. Регламент Клиринг орталығы орталық контрагенттің функцияларын жүзеге асыратын операциялар бойынша биржалық нарықтардағы клирингілік қызмет шеңберінде Клиринг орталығы жүзеге асыратын рәсімдердің уақытын анықтайды.
2. Регламентте пайдаланылатын ұғымдар Қазақстан Республикасының заңнамасында көзделген, сондай-ақ Клиринг орталығының "қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асыру қағидалары" ішкі құжатында айқындалған ұғымдармен бірдей.

2-бап. Клирингілік сессияларды өткізу уақыты

1. Клиринг орталығы клирингілік қызмет бойынша барлық қажетті рәсімдерді жүзеге асыратын клирингілік күн 08.00 ALT-де басталып, 23.59 ALT-де аяқталады.
2. Клиринг орталығының белгілі бір биржалық нарықтарда орталық контрагенттің функцияларын орындайтын мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асыру уақыты Регламентке 1-3 – қосымшаларында белгіленген.
3. Клирингілік сессияларды өткізу уақытын Клиринг орталығының Басқарма Төрағасының клирингілік бөлімшеге жетекшілік ететін орынбасары немесе оның міндетін атқарушы тұлға клирингілік сессияларды өткізу кезінде пайдаланылатын бағдарламалық-техникалық құралдардың жұмысында іркіліс болған, клирингілік сессияларды әдеттегідей өткізуге кедергі келтіретін мән-жайлар анықталған жағдайларда өзгерте алады.
4. Қандай да бір кезеңде клирингілік сессияларды өткізуде кідіріс туындаған жағдайда, келесі кезеңнің басталу уақыты туындаған кідіріс уақытынан аспайтын уақытқа ауысады.

3-бап. Клирингілік қатысушыларға ұсынылатын клирингілік есептерді қалыптастыру тәртібі

1. Кез келген биржалық нарықтың клирингілік есептері клирингілік жүйеде қалыптастырылады және клирингілік қатысушыларға электрондық құжаттармен алмасу жүйесі арқылы жіберіледі eTransfer.kz². Бұл ретте:
 - 1) Қор нарығының клирингілік есептері XML (8, 9-қосымшалар), XLS, XML (4, 5, 6, 7, 10-қосымшалар) форматында және PDF форматында (11-қосымша) қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады.
 - 2) Валюта нарығының клирингілік есептері XLS, XML (12, 13, 14, 15, 16, 17-қосымшалар) форматында және PDF (18-қосымша) қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады.
 - 3) Туынды құралдар нарығының клирингілік есептері XLS, XML (19, 20-қосымшалар) және PDF (21-қосымша) форматында құрылған электрондық құжаттар болып табылады.
2. Кез-келген биржалық нарықтың XLS, XML, PDF форматындағы әрбір клирингілік есебінде мәтін жолдары түріндегі тақырып және деректері бар жолдар болып табылатын мазмұн бөлігі бар.
3. Кез келген биржалық нарықтың XML форматындағы әрбір клирингілік есебін келесіге түрлендіруге болады:

² Клиринг орталығы мен клирингілік қатысушы арасындағы көпілдендірілген жеткізіліммен және берілетін деректердің құпиялылығы мен түзетілмейтіндігін қамтамасыз ететін криптографиялық қорғау құралдарымен электрондық құжат айналымының мамандандырылған жүйесі.

- алушыға ыңғайлы кез-келген формат (соның ішінде бөлгіштері бар ТХТ форматы) өзінің бэк-офис бағдарламалық жасақтамасымен және/немесе стандартты бағдарламалық жасақтамамен (MS Excel) өңдеу арқылы;
- Microsoft Internet Explorer-де файлды ашу арқылы баспа түрінде.

4-бап. Қорытынды ережелер

1. Регламентке өзгерістер мен толықтырулардың уақтылы енгізілуіне клирингтік бөлімше жауапты болады.
2. Регламент қажеттілігіне қарай, бірақ кемінде үш жылда бір рет өзектендіруге жатады.

Басқарма Төрағасы

Сабитов И.М.

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

1-қосымша

Қор нарығындағы есеп айырысу-клирингтік сессиялар РЕГЛАМЕНТІ

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
А	1	2
1.	09:00 – 10:30 <i>(осы ұяшықтың мәтіні Клиринг орталығы Басқармасының 2024 жылғы 23 ақпандағы шешімімен өзгертілді).</i>	Mark-to-market клирингтік сессиясы
2.		Маржа талаптарын анықтау
3.		Репо мәмілелері және Үн сатып алу/сату мәмілелері бойынша купондар мен дивидендтер бойынша төлемдерді қайтару ³
4.		Клирингтік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат – табыс беру жөніндегі міндеттемелер / табыс алу жөніндегі талаптар туралы ақпарат – мүлктік пулдарға енгізілген мүлік туралы ақпарат.
5.	15:30 – 17:30	Бірінші есеп айырысу-клирингтік сессия
6.		ALT 15:30-ға дейін жасалған орындалу күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді айқындау
7.		Клирингтік қатысушыларға ALT 15:30-ға дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
8.	16:00	Клирингтік қатысушылардың қаржы құралдарын (ақшаны – Орталық депозитарийдегі Клиринг орталығының корреспонденттік шотына, бағалы қағаздарды – KASE бөліміне) орындаудың басталған күні ALT 15:30-ға дейін жасалған, өзін-өзі реттеу режимдерінде жасалған мәмілелерді ескере отырып, ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді орындау үшін жеткізудің соңғы уақыты 16:00 ALT

³ Ішінара қамтамасыз етілген мәмілелер және мәміле жасалған күннен өзгеше есеп айырысу күні бойынша.

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
9.		ALT 16:00-ге дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың орындалмаған нетто-міндеттемелерін реттеу
10.		ALT 16:35-ке дейін жасалған толық қамтылған мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді айқындау
11.		Бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
12		Нетто-операцияларды тіркеуге бұйрық бойынша есеп айырысудан бас тартылған жағдайда қосымша жүргізіледі: Нетто–операцияларды тіркеуге арналған бұйрықты есептеуден бас тартуға байланысты қатысушылардың нетто-міндеттемелерінің дефолтын реттеу; Нетто міндеттемелер дефолтын реттеу мәмілелерін ескере отырып, бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
13		Клирингтік қатысушыларға бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша қорытынды нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
14	17:30 – 19:15	Екінші есеп айырысу-клирингтік сессия
15		ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған орындалу күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша қорытынды нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді айқындау
16		Клирингтік қатысушыларға ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған орындау күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
17	17:45	Клирингтік қатысушылардың қаржы құралдарын (ақшаны – Орталық депозитарийдегі Клиринг орталығының корреспонденттік шотына, бағалы қағаздарды – KASE бөліміне) орындалған мәмілелерді ескере отырып, ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді орындау үшін жеткізудің соңғы уақыты 17:45 ALT дейін өзін-өзі реттеу режимдерінде
18		ALT 17:45-ке дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың орындалмаған нетто-міндеттемелерін реттеу
19		Екінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
20		Нетто-операцияларды тіркеуге бұйрықты есептеуден бас тартқан жағдайда қосымша жүргізіледі: Нетто–операцияларды тіркеуге арналған бұйрықты есептеуден бас тартуға байланысты қатысушылардың нетто-міндеттемелерінің дефолтын реттеу; Нетто міндеттемелер дефолтын реттеу мәмілелерін ескере отырып, бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу.
21		Клирингтік қатысушыларға есептер беру: – екінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша қорытынды нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы;

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
А	1	2
		– болашақ есеп айырысу күндерімен мәмілелер бойынша нетто- міндеттемелер / нетто-талаптар туралы; – клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы.

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

2-қосымша

**Валюта нарығындағы есеп айырысу-клирингілік сессиялар
РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	09:00-09:30	Mark-to-market клирингілік сессиясы
2.		Орындаудың басталмаған күндерімен мәмілелер бойынша маржалық талаптарды айқындау
3.		Вариациялық маржаны алу жөніндегі міндеттемелерді / талаптарды айқындау
4.		Клирингілік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат; – Вариациялық маржаны алу жөніндегі міндеттемелер / талаптар туралы ақпарат
5.	11:30 – 12:00	CNY есептеулеріне арналған таңертеңгі клирингілік сессия
6.		Қытайлық юаньдағы нетто талаптарды / нетто міндеттемелерді орындау мерзімі аяқталған мәмілелер бойынша анықтау
7.		Орындалатын күні бар мәмілелер бойынша қытай юанімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
8.		Клирингілік қатысушыларға Қытай юаньіндегі нетто талаптар / нетто міндеттемелер туралы есептерді орындау күні басталған мәмілелер бойынша ұсыну
9.	12:15 <i>(осы ұяшықтың мәтіні Клиринг орталығы Басқармасының 2024 жылғы 23 ақпандағы шешімімен өзгертілді).</i>	Клиринг орталығына қытайлық юань клирингілік қатысушыларының орындалатын күні бар мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеу үшін жеткізудің соңғы уақыты
10.		Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша клирингілік сессия
11.	<i>(осы ұяшықтың мәтіні Клиринг</i>	ALT 12:15-тен 12:30-ға дейін жасалған Қытай юаньдері бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
	<i>орталығы Басқармасының 2024 жылғы 23 ақпандағы шешімімен өзгертілді).</i>	міндеттемелерді анықтау <i>(осы ұяшықтың мәтіні Клиринг орталығы Басқармасының 2024 жылғы 23 ақпандағы шешімімен өзгертілді).</i>
12.		Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
13.		Клирингілік қатысушыларға қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
14.	15:30 – 16:00	T0 бойынша есептеулерге арналған негізгі клирингілік сессия
15.		Орындалу күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгедегі, АҚШ долларындағы, еуроғағы, ресей рубліндегі нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді айқындау
16.		Орындалу күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгемен, АҚШ долларымен, еуромен, ресей рублімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
17.		Клирингілік қатысушыларға орындалған күні бар мәмілелер бойынша қазақстандық теңгедегі, АҚШ долларындағы, еуроғағы, ресей рубліндегі нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
18.	17:00	Клиринг орталығына клирингілік қатысушылардың қазақстандық теңгені, АҚШ долларын, еуроны, ресей рублін орындалатын күні бар мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеуге жеткізудің соңғы уақыты
19.	17:30 – 18:00	Қосымша клирингілік сессия
20.		Жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді айқындау: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
21.		Жасалған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгеде, АҚШ долларында, еуроға, ресей рублінде есеп айырысулар жүргізу: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
22.		Клирингілік қатысушыларға жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
23.	19:00-19:30	Жосықсыз клирингілік қатысушылармен клирингілік сессия
24.		Клирингілік қатысушылардың орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін орындау күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгемен, АҚШ долларымен, еуромен, ресей рублімен, қытай юанімен реттеу

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
А	1	2
25.		Орындалмаған позицияларды келесі жұмыс күніне ауыстыру мәмілелерін жасау

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

3-қосымша

(Бұл қосымша Клиринг орталығы басқармасының 2024 жылғы 14 тамыздағы шешімімен өзгертілді)

Туынды құралдар нарығындағы клирингілік сессия РЕГЛАМЕНТІ

№ р/ с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
А	1	2
1.	13:00	Вариациялық маржа бойынша қорытынды нетто-міндеттемелерді орындау үшін клирингілік қатысушылардың ақша жеткізуінің соңғы уақыты
2.	13:00 – 17:30	Margin-call бойынша клирингілік қатысушылардың орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеу
3.	17:30 – 18:00	Аралық клирингілік сессия
4.		Әрбір есеп айырысу коды / агрегатталған сауда -клирингілік шот / сегрегатталған сауда -клирингілік шот бойынша жасалған мәмілелер бойынша клирингілік қатысушылардың аралық нетто-талаптарын / нетто-міндеттемелерін айқындау
5.		Кепілдік қамтамасыз етуді есептеу
6.		Сауда лимитін есептеу
7.	21:30 – 22:00	Соңғы клирингілік сессия
8.		Әрбір есеп айырысу коды / агрегатталған сауда -клирингілік шот / сегрегатталған сауда -клирингілік шот бойынша жасалған мәмілелер бойынша клирингілік қатысушылардың қорытынды нетто-талаптарын / нетто-міндеттемелерін айқындау
9.		Кепілдік қамтамасыз етуді есептеу
10.		Сауда лимитін есептеу
11.		Margin-call бекіту
12.	23:59-ға дейін	Клирингілік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – сауда -клирингілік шоттарда ескерілетін позициялар туралы; – Вариациялық маржаны алу бойынша төлемдер / талаптар бойынша қорытынды міндеттемелер туралы; – margin-call туралы ақпарат

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

4-қосымша

Клирингтік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы АЛДЫН АЛА ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNT_Ses1_PRE *		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингтік сессиясының реттік нөмірі "1" – 15:30-дағы клирингтік сессия "2" – 17:30-да клирингтік сессия		integer		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингтік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" – бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	DEBIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_PRE *						
/KASE_DOC						

* TNT_Ses1_PRE – бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау;

TNT_Ses2_PRE – екінші есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне
5-қосымша

**Клирингтік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы
ҚОРЫТЫНДЫ ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNT_Ses1_FIN *		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингтік сессиясының реттік нөмірі "1" – 15:30-дағы клирингтік сессия "2" – 17:30-да клирингтік сессия		integer		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингтік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" – бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	DEBIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_FIN *						
/KASE_DOC						

* TNT_Ses1_FIN – бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау;

TNT_Ses2_FIN – екінші есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

6-қосымша

Margin-call туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
MRC		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Клирингілік қатысушының негізгі ақшалай позициясының коды	+	string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Margin-call сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

/MRC						
/KASE_DOC						

* Екінші деңгейдегі сауда-клирингтік шоттарға байланыстыру үшін қолданылады.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

7-қосымша

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

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
TNF		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
POSTYPES		Ақша позициясы бойынша немесе депозитарлық бөлім бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" –бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string		
GROUP		Клирингілік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	10	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз		string	12	
	DEBIT_NETTO_Y0	Нетто міндеттеме / міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_NETTO_Y0	Нетто талап	+	decimal	20	2
	SETTLEDATE	Орындалу күні	+	date		
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/POSTYPES						
/FIRM						
/TNF						
/KASE_DOC						

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

8-қосымша

Табыс беру жөніндегі міндеттемелер / табыс алу жөніндегі талаптар туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
RFN		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Бас фирманың атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингтік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шотының коды	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" –бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string		
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	Сауда-саттық жүйесіндегі мәміле нөмірі *	+	string	20	0
	OPERATION_NO	Сауда жүйесіндегі кірісті есептеу операциясының нөмірі	+	string	20	
	TRADE_DATE	Мәміле жасалған күн	+	date		

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	SETTLEDATE1	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 1-бөлігінің орындалу күні	+	date		
	SETTLEDATE2	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 2-бөлігінің орындалу күні	+	date		
	RECORD_DATE	Табыс алуға құқығы бар адамдардың тізімін жасау күні	+	date		
	DEBIT/CREDIT	Табысты беру жөніндегі міндеттеменің бағыты (міндеттеме (D) / талап (C))	+	string		
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
	QUANTITY	Мәміле көлемі, бағалы қағаздарда	+	decimal	20	0
	PRICE	Табыс	+	decimal	38	16
	REFUND_SUM	Кірісті беру бойынша міндеттеме / талап сомасы	+	decimal	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/RFN						
/KASE_DOC						

* "TradeNo" жолағында бет мәмілесінің нөмірі көрсетіледі.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

9-қосымша

Таза негізде клирингке кірген мәмілелер бойынша

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
CNT		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	Клирингтік қатысушының сауда коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық режимі бойынша деректер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық режимінің идентификаторы	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық режимінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Есеп айырысу валютасы бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
RECORDS		Мәміле бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	ASTS+ сауда-клирингтік жүйесіндегі мәміле нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	BUY_SELL	Мәміле / мәміле бөлігі (сатып алу (B) / сату (S))	+	string	1	
	SETTLECODE	Мәміле бойынша есеп айырысу коды	+	string	6	
	TRADE_TYPE	Мәміле түрі	+	string	1	
	PRICE	Бір бағалы қағаздың бағасы	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Бағалы қағаздардағы / шетел валютасындағы мәміле көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Ақшадағы мәміле көлемі	+	decimal	20	2
SETTLE		Есептеулер бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Нақты есеп айырысу күні	+	date		
	SETTLETIME	Есеп айырысу уақыты	+	time		
	SESSION_NO	Клирингтік сессияның нөмірі	+	integer	1	
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNT						
/KASE_DOC						

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

10-қосымша

**Мүліктік пулдарға енгізілген мүлік туралы
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
GCG		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Бас фирманың идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
GROUP		Клирингтік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шотының коды	+	string	12	
	DEP_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының депо шотының коды	+	string		
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
RECORDS		ЖК-ге енгізілген мүлік бойынша ақпарат блогы				
	QUANTITY	Депо шотындағы бағалы қағаздардың саны	+	decimal	20	0

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	BALANCE	Есеп айырысу коды бойынша ақша қаражатының көлемі	+	decimal	20	2
	DOC_DATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/GCG						
/KASE_DOC						

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

11-қосымша

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы ЕСЕП

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы есеп

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингтік қатысушының атауы: _____

Клирингтік қатысушының сауда коды: _____

Клирингтік кепілдік қоры бойынша клирингтік қатысушының талаптары мен міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Кепілдік жарнаның қажетті мөлшері:	
банк болып табылатын клирингтік қатысушы үшін	
банк болып табылмайтын клирингтік қатысушы үшін	
Сауда-саттық басталғанға дейінгі кепілдік жарнаның мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін кепілдік жарнадан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Дәрменсіз клирингтік қатысушылардың міндеттемелерін жабу үшін кепілдік жарнадан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша кепілдік жарнаның мөлшері	
Кепілдік жарнаны қалпына келтіру бойынша міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингтік резервтік қор бойынша клирингтік қатысушының міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингтік резервтік қордан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

12-қосымша

Клирингтік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшем і	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNTall*		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингтік сессиясының реттік нөмірі	+	integer		
		2 – CNY есептеулеріне арналған клирингтік сессия				
		3 – CNY бойынша өтімділік провайдерлерімен есеп айырысуға арналған клирингтік сессия				
		4 – T0 бойынша есептеулерге арналған негізгі клирингтік сессия				
		5 – қосымша клирингтік сессия				
		6 – жосықсыз клирингтік қатысушылармен клирингтік сессия				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
GROUP		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
CURRENCY						
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	2
SETTLE						
	DEBIT	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшем і	Ондық бөлшектер
	NETTO	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT						
/KASE_DOC						

* *TNT_ – есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін есепті кодтау.*

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

13-қосымша

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

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNTFINfx		Есеп деректерінің блогы				
	TODAYDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	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 ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
SETTLE		Мәмілелер бойынша есеп айырысу міндеттемелері / талаптары бойынша ақпарат блогы				
	NETTO_FOREX	Нетто-талап / сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_VARMARGIN	Нетто-талап / вариациялық маржа бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Қорытынды нетто-талап немесе нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNTFINfx						
/KASE_DOC						

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

14-қосымша

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

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNFfx*		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADEDATE	Есеп айырысу күні	+	datetime		
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингтік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "CASH" болса, онда салынған түйіндер ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпаратты қамтиды. Егер "SECURITY" болса, түйіндер қаржы құралдары бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпаратты қамтиды	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Қаржы құралдары бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының идентификаторы	+	string	12	

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	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 бойынша мәмілелер бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша мәмілелер бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_BUYSELL	Нетто-талап / сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша 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	Есеп айырысу 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 клирингтік сессиясы үшін болашақ нетто есепті кодтау.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша

клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

15-қосымша

Margin-call туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
MRCfx		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентифика торы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда 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						

* MRC fx – margin-call есебін кодтау.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингілік сессияларды өткізу
Регламентіне

16-қосымша

**Клирингке кірген мәмілелер бойынша
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
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	Клирингілік қатысушының сауда коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық режимі бойынша деректер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық режимінің идентификаторы	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық режимінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Есеп айырысу валютасы бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
SECURITY		Қаржы құралы бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	
RECORDS		Мәміле бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	ASTS+ сауда-клирингілік жүйесіндегі мәміле нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		
	BUY_SELL	Мәміле / мәміле бөлігі (сатып алу (B) / сату (S))	+	string	1	

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	PRICE	Мәміле курсы. Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары үшін ашылу немесе жабылу мәмілесінің бағасы.	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Қаржы құралдары санындағы мәміле көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Мәміле көлемі ақшамен, есеп айырысу валютасымен	+	decimal	20	2
SETTLE		Есептеулер бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Нақты есеп айырысу күні	+	date		
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNTfx						
KASE_DOC						

* CNTfx – таза негізде клирингке енгізілген мәмілелер бойынша есепті кодтау.

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

17-қосымша

**Вариациялық маржаны төлеу жөніндегі міндеттемелер / талаптар туралы
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
VMR		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда 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 идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	
SETTLEDATE		Орындалу күні бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Орындалу күні	+	datetime		
RECORDS		Валюта нарығының туынды қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша міндеттемелер / талаптар бойынша ақпарат блогы				
	PREVIOUS_SETTLE_PRICE	Алдыңғы есеп айырысу бағасы (алдыңғы сауда күнінен бұрын жасалған мәмілелер үшін) / мәміле бағасы (алдыңғы сауда күнінде жасалған мәмілелер үшін)		number	20	6
	PREVIOUS_QUANTITY	Алдыңғы сауда күніндегі базалық активтің саны		number	20	2

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	PREVIOUS_TRADE_VOLUME	Алдыңғы сауда күніндегі мәміле көлемі		number	20	2
	CURRENT_SETTLE_PRICE	Мәміленің ағымдағы есеп айырысу бағасы		number	20	6
	CURRENT_QUANTITY	Ағымдағы сауда күніндегі базалық активтің саны		number	20	2
	CURRENT_TRADE_VOLUME	Ағымдағы сауда 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.

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

18-қосымша

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы ЕСЕП

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингтік қатысушының атауы: _____

Клирингтік қатысушының сауда коды: _____

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

Клирингтік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қор бойынша міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингтік резервтік қордан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

19-қосымша

**Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шоттарының позициялық жай-күйі туралы
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
FUTPOS*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	account	Клирингтік қатысушының сауда коды	+	string	120	
ISIN						
	isin	Құралдың таңбалық коды	+	string	10	
SETTLE						
	pos_beg	Күннің басындағы позиция	+	decimal	20	2
	pos_end	Күннің соңындағы позиция	+	decimal	20	2
FEE						
	fee	Клиент / фирма және құрал үшін жиынтық алым				
	fee_ex	Биржалық алым		decimal	20	2
	fee_cc	Клирингтік алым		decimal	20	2
VM						
	vm	Вариациялық маржа				

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/ISIN						
/FIRM						
/FUTPOS*						
/KASE_DOC						

* *FUTPOS_ – есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін есепті кодтау.*

орталық контрагентпен мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

20-қосымша

**Клирингтік қатысушының сауда-клирингтік шоттарының ақшалай жағдайы туралы
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
FUTMON*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	account	Клирингтік қатысушының сауда коды	+	string	120	
SETTLE						
	amount_beg	Күннің басына ақша	+	decimal	20	2
	pay	Шот бойынша қозғалыс	+	decimal	20	2
	amount_end	Күннің соңына дейінгі ақша				
FEE						
	go	Фьючерстер бойынша жиынтық MO				
	fee_fut	Фьючерстік биржалық алым		decimal	20	2
VM						
	vm	Вариациялық маржа				

Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
LIMIT						
	free					
/LIMIT						
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/FIRM						
/FUTMON*						
/KASE_DOC						

* *FUTMON_ – есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін есепті кодтау.*

орталық контрагентпен
мәмілелер бойынша
клирингтік сессияларды өткізу
Регламентіне

21-қосымша

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы ЕСЕП

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингтік қатысушының атауы: _____

Клирингтік қатысушының сауда коды: _____

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

Клирингтік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингтік резервтік қор бойынша клирингтік қатысушының міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингтік резервтік қордан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс
