

# "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

---

---

"Қазақстан қор Биржасы" АҚ  
Директорлар кеңесінің шешімімен

(2019 жылдың 29 қарашасындағы  
№ 147 отырыс хаттамасы)  
**б е к і т і л д і**

2019 жылдың 03 желтоқсанынан бастап  
**қолданысқа енгізілді**

## Орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу **РЕГЛАМЕНТІ**

*(Бұл тақырып Биржа Басқармасының 2020 жылдың 18 маусымдағы шешімімен өзгертілген)*

---

---

Алматы қ  
2019 жыл

## ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

### 1. № 1 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2020 жылдың 18 маусымындағы № 84 отырыс хаттамасы);
- 2020 жылдың 03 тамызынан бастап қолданысқа енгізілді.

### 2. № 2 өзгертулер

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2020 жылдың 17 қарашадағы № 151 отырыс хаттамасы);
- 2020 жылдың 30 қарашасынан бастап қолданысқа енгізілді.

### 3. № 3 өзгерту

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2021 жылдың 01 шілдесіндегі № 65 отырыс хаттамасы);
- 2021 жылдың 07 шілдесінен бастап қолданысқа енгізілді.

### 4. № 4 өзгерту

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2022 жылдың 29 шілдесіндегі № 92 отырыс хаттамасы);
- 2022 жылдың 22 тамызынан бастап қолданысқа енгізілді.

### 5. № 5 өзгерту

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2022 жылдың 20 қыркүйегіндегі № 109 отырыс хаттамасы);
- 2022 жылдың 20 қыркүйегінен бастап қолданысқа енгізілді.

### 6. № 6 өзгерту

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілген (2022 жылдың 07 желтоқсанындағы № 142 отырыс хаттамасы);
- 2022 жылдың 07 желтоқсанынан бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Регламент орталық контрагенттің функцияларын орындай отырып, "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) биржалық нарықтардағы қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингтік қызметті жүзеге асыруының уақытша тәртібін анықтайды.

1. Осы Регламентте пайдаланылатын ұғымдар Биржаның "Қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингтік қызметті жүзеге асыру ережелері" ішкі құжатында және Биржаның өзге ішкі құжаттарында анықталған ұғымдарға ұқсас.
2. Осы Регламент Биржа орталық контрагент қызметін атқаратын мәмілелер бойынша биржалық нарықтарда клирингтік қызметті жүзеге асыру шеңберінде өткізілетін процедураларды өткізу уақытын анықтайды.
3. Биржа клирингтік қызмет бойынша барлық қажетті процедураларды жүзеге асыратын клирингтік күн 08.00 ALT басталады және 23.59 ALT аяқталады (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2022 жылдың 29 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
4. Биржаның клирингтік қызметті жүзеге асыру уақыты Биржа белгілі бір Биржалық нарықтардағы орталық контрагенттің функцияларын орындайтын мәмілелер бойынша осы Регламенттің қосымшасы белгіленген.
5. Клирингтік сессияларын өткізу уақытын клирингтік бөлімшесіне жетекшілік ететін Биржа Басқармасы Төрағасының орынбасары немесе оның міндетін атқарушы тұлға клирингтік сессияларын өткізу кезінде пайдаланылатын бағдарламалық-техникалық құралдардың жұмысында іркіліс болған, клирингтік сессияларын әдеттегі тәртіптемеде өткізуге кедергі келтіретін мән-жайлар немесе өзге де мән-жайлар анықталған жағдайларда өзгертуі мүмкін.
6. Қандай да бір кезеңде клирингтік сессияларды өткізуде кідіріс туындаған жағдайда, келесі кезеңнің басталу уақыты туындаған кідіріс уақытынан аспайтын уақытқа ауыстырылады.
7. Осы Регламентке өзгертулер мен толықтыруларды уақтылы енгізу үшін клирингтік бөлімше жауапты болады.
8. Осы Регламенттің қажеттілігіне қарай, бірақ үш жылда кемінде бір рет өзектілендірілуі тиіс.

Басқарма Төрайымы

А.Ө. Алдамберген

Орталық контрагентпен  
мәмілелер бойынша  
клирингілік сессияларды  
өткізу регламентіне

**1 қосымша**

*(Осы қосымша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 18 маусымындағы, 2022 жылдың 29 шілдесіндегі, 2022 жылдың 20 қыркүйегіндегі және 2022 жылдың 07 желтоқсанындағы шешімімен өзгертілген)*

**Қор нарығындағы есеп айырысу-клирингілік сессиялардың  
РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	10:00 – 10:30	<b>Mark-to-market клирингілік сессиясы</b>
2.		Маржа талаптарын анықтау
3.		Репо мәмілелері және сатып алу/сату мәмілелері Yn <sup>1</sup> бойынша купондар мен дивидендтер бойынша төлемдерді қайтару
4.		Клирингілік қатысушыларға мыналарды қамтитын есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат – табыс беру жөніндегі міндеттемелер/табыс алу жөніндегі талаптар туралы ақпарат – мүлтік пулдарға енгізілген мүлік туралы ақпарат.
5.	15:30 – 17:30	<b>Бірінші есеп айырысу-клирингілік сессия</b>
6.		ALT 15:30-ға дейін жасалған орындалу күні басталған жартылай қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды/нетто-міндеттемелерді анықтау
7.		Клирингілік қатысушыларға ALT 15:30-ға дейін жасалған, орындалу күні басталған жартылай қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптар/нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
8.	16:00	Клирингілік қатысушылардың орындалу күні басталған жартылай қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды/нетто-міндеттемелерді орындау үшін қаржы құралдарын жеткізудің соңғы уақыты (ақшаны – Орталық депозитарийдегі KASE корреспонденттік шотына, бағалы қағаздарды – KASE бөліміне), ALT 15:30-ға дейін өзін-өзі реттеу тәртіптемелерінде жасалған мәмілелерді ескере отырып, ALT 16:00-ге дейін
9.		ALT 16:00-ге дейін жасалған, орындалу күні басталған жартылай қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша клирингілік қатысушылардың орындалмаған нетто-міндеттемелерін реттеу

<sup>1</sup> Жартылай қамтамасыз етілген мәмілелер және мәміле жасалған күннен өзгеше есеп айырысу күні бойынша.

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

*(Осы қосымша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 18 маусымындағы және  
2020 жылдың 17 қарашасындағы шешімдерімен өзгертілген)*

**Валюта нарығындағы есеп айырысу-клиринг сессияларының  
РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/н	Операцияны жүргізу уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	09:00-09:30	<b>Mark-to-market клирингілік сессиясы</b>
2.		Орындалмаған орындау күндерімен мәмілелер бойынша маржалық талаптарды анықтау
3.		Вариациялық маржаны алу бойынша төлеу бойынша міндеттемелерді/талаптарды анықтау
4.		Клирингілік қатысушыларға есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат; – Вариациялық маржаны алу бойынша төлеу бойынша міндеттемелер/талаптар туралы ақпарат
5.	12:00 – 12:30	<b>CNY бойынша есеп айырысуға арналған таңғы клирингілік сессия</b>
6.		Орындау күні келген мәмілелер бойынша қытай юанінде нетто-талаптарды/нетто-міндеттемелерді анықтау
7.		Орындау күні келген мәмілелер бойынша қытай юанінде мәмілелер бойынша есеп айырысу жүргізу
8.		Клирингілік қатысушыларға орындау күні келген мәмілелер бойынша қытай юанінде нетто-талаптар/нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
9.	13:00	Қытай юанінің клирингілік қатысушыларының Биржаға орындау күні келген мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеуге жеткізудің соңғы уақыты
10.	13:30-13:45	<b>Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша клирингілік сессия</b>
11.		ALT 13:00-ден 13:30-ға дейін жасалған қытай юандары бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды /нетто-міндеттемелерді анықтау
12.		Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша есеп айырысу жүргізу
13.		Клирингілік қатысушыларға қытай юандары бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну

№ р/н	Операцияны жүргізу уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
14.	15:30 – 16:00	<b>T0 бойынша есеп айырысуға арналған негізгі клирингтік сессия</b>
15.		Орындау күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгеде, АҚШ долларында, еурода, ресей рублінде нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
16.		Қазақстандық теңгеде, АҚШ долларында, еурода, ресей рублінде жасалған мәмілелер бойынша орындау күні басталған мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
17.		Клирингтік қатысушыларға Қазақстан теңгесіндегі, АҚШ долларындағы, еуродағы, ресей рубліндегі нетто-талаптар/нетто-міндеттемелер туралы есептерді орындау күні басталған мәмілелер бойынша ұсыну
18.	17:00	Клирингтік қатысушылардың орындау күні басталған мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеуге қазақстандық теңгені, АҚШ долларын, еуроны, ресей рублін биржаға жеткізудің соңғы уақыты
19.	17:30 – 18:00	<b>Қосымша клирингтік сессия</b>
20.		Жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау: – қосымша сауда сессиясында; – 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған Еуро, Ресей рублі бойынша өтімділік провайдерлерімен ALT
21.		Жасалған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгемен, АҚШ долларымен, евромен, Ресей рублімен есеп айырысуларды жүргізу: – қосымша сауда сессиясында; – 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған Еуро, Ресей рублі бойынша өтімділік провайдерлерімен ALT
22.		Клирингтік қатысушыларға жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптар/нетто-міндеттемелер туралы есептер беру: – қосымша сауда сессиясында; – 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған Еуро, Ресей рублі бойынша өтімділік провайдерлерімен ALT
23.	19:00-19:30	<b>Жосықсыз клирингтік қатысушылармен клирингтік сессия</b>
24.		Клирингтік қатысушылардың қазақстандық теңгеде, АҚШ долларында, еурода, ресей рублінде, қытай юанінде орындалған күнмен мәмілелер бойынша орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеу
25.		Орындалмаған позицияларды келесі жұмыс күніне ауыстыру мәмілелерін жасасу



Орталық контрагентпен  
мәмілелер бойынша  
клирингілік сессияларды  
өткізу регламентіне

3 қосымша

(Осы қосымша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 18 маусымындағы және  
2021 жылдың 01 шілдесіндегі шешімдерімен өзгертілген)

**Деривативтер нарығындағы клирингілік сессияның**

**РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/с	Операцияны өткізу уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	14:00	<b>Margin call</b> бойынша клирингілік қатысушылардың қорытынды нетто-міндеттемелерді орындауының соңғы уақыты
2.	14:00 – 17:30	Клирингілік қатысушылардың маржалық талаптар бойынша орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеу
3.		Клирингілік қатысушылардың маржалық талаптар бойынша орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеуді ескере отырып, клирингілік қатысушыларға маржалық талаптар бойынша қорытынды нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
4.		Клирингілік қатысушылардың маржалық талаптар бойынша орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеу қорытындылары бойынша есеп айырысу жүргізу
5.	15:30 – 15:31	<b>Аралық клирингілік сессия</b>
6.		Бастапқы, қолдау көрсетілетін және вариациялық маржа бойынша қорытынды нетто-міндеттемелерді / нетто талаптарды анықтау
7.	17:30	<b>Сауда-саттықтың аяқталуы</b>
8.	17:30 – 20:30	<b>Тәуекел-параметрлерді есептеу</b>
9.	20:30 – 20:35	<b>Соңғы клирингілік сессия</b>
10.		Бастапқы, қолдау көрсетілетін және вариациялық маржа бойынша қорытынды нетто-міндеттемелерді / нетто талаптарды анықтау
11.		Клирингілік қатысушыларға бастапқы, қолдау көрсетілетін және вариациялық маржа бойынша қорытынды нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
12.	20:35	<b>Клиринг қорытындылары бойынша есеп айырысулар жүргізу</b>
13.		<b>Орындау күндері келмеген мәмілелер бойынша маржалық талаптарды анықтау</b>