

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

---

**У т в е р ж д е н ы**

решением Правления  
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания  
от 29 ноября 2019 года № 147)

**Введены в действие**

с 03 декабря 2019 года

## ФОРМАТЫ клиринговых отчетов на фондовом рынке

**ЛИСТ ПОПРАВК**

**1. Дополнение № 1:**

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 17 января 2020 года № 4);
- введено в действие с 20 января 2020 года.

**2. Изменения и дополнения № 2:**

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 июля 2020 года 2020 года № 103);
- введено в действие с 29 июля 2020 года.

Настоящие Форматы клиринговых отчетов на фондовом (далее – Форматы) рынке разработаны в соответствии с внутренними документами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), регулирующими осуществление клиринговой деятельности, и описывают формы и форматы отчетов, предоставляемых клиринговым участникам.

1. В настоящих Форматах используются понятия и термины, определенные законодательством Республики Казахстан и другими внутренними документами Биржи.
2. Клиринговые отчеты фондового рынка формируются в клиринговой системе в порядке, установленном внутренним документом Биржи "Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом", и направляются клиринговым участникам посредством системы обмена электронными документами eTransfer.kz<sup>1</sup> (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 июля 2020 года*).
3. Клиринговые отчеты фондового рынка являются электронными документами, сформированными в формате XML (приложения 1, 2, 3, 4, 5, 7) и PDF (приложение 6) (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 июля 2020 года*).
4. Каждый клиринговый отчет фондового рынка в формате XML содержит заголовок в виде текстовых строк и содержательную часть, представляющую собой строки с данными.
5. Каждый клиринговый отчет фондового рынка в формате XML может быть преобразован в:  
любой удобный получателю формат (в том числе, формат TXT с разделителями) путем обработки собственными программными средствами бэк-офиса и/или стандартными программными средствами (MS Excel);  
в печатную форму путем открытия файла в Microsoft Internet Explorer.

---

<sup>1</sup> Специализированная система электронного документооборота между Биржей и клиринговым участником с гарантированной доставкой и криптографическими средствами защиты, обеспечивающая конфиденциальность и некорректируемость передаваемых данных.

Приложение 1  
к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

**ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫЙ ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNT_Ses1_PRE *		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
	SESSION_NO	Порядковый номер расчетной клиринговой сессии, для которой сформирован предварительный отчет о нетто-требованиях / нетто-обязательствах		integer		
		"1" – клиринговая сессия в 15:30				
		"2" – клиринговая сессия в 17:30				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	

## Форматы клиринговых отчетов на фондовом рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценным бумагам				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				
	DEBIT_Y0	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_PRE *						
/KASE_DOC						

- \* *TNT\_Ses1\_PRE* – кодировка предварительного отчета для первой расчетной клиринговой сессии;  
*TNT\_Ses2\_PRE* – кодировка предварительного отчета для второй расчетной клиринговой сессии.

**Приложение 2**  
к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

**ИТОГОВЫЙ ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNT_Ses1_FIN *		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
	SESSION_NO	Порядковый номер расчетной клиринговой сессии, для которой сформирован предварительный отчет о нетто-обязательствах / нетто-требованиях		integer		
		"1" – клиринговая сессия в 15:30				
		"2" – клиринговая сессия в 17:30				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	

## Форматы клиринговых отчетов на фондовом рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценным бумагам				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				
	DEBIT_Y0	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_FIN *						
/KASE_DOC						

- \* *TNT\_Ses1\_FIN – кодировка итогового отчета для первой расчетной клиринговой сессии;*  
*TNT\_Ses2\_FIN – кодировка итогового отчета для второй расчетной клиринговой сессии.*

Приложение 3

к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

**ОТЧЕТ**  
**о margin-call**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
MRC		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Код основной денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Сумма margin-call, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						
/MRC						
/KASE_DOC						

\* Используется для привязки к торгово-клиринговым счетам второго уровня.



Приложение 4

к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

**ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах по сделкам  
с наступившей датой расчетов**

*(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 28 июля 2020 года)*

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
TNF		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
POSTYPES		Блок информации по денежной позиции или по депозитарному разделу				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string		
GROUP		Блок данных по счетам клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов		string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	30	
RECORDS		Блок данных по обязательствам				

## Форматы клиринговых отчетов на фондовом рынке

	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	10	
	ISIN	ISIN ценной бумаги		string	12	
	DEBIT_NETTO_Y0	Нетто-обязательство / обязательство	+	decimal	20	2
	CREDIT_NETTO_Y0	Нетто-требование / требование	+	decimal	20	2
	SETTLEDATE	Дата исполнения	+	date		
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/POSTYPES						
/FIRM						
/TNF						
/KASE_DOC						

**Приложение 5**  
к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

**ОТЧЕТ**

**об обязательствах по передаче / требованиях по получению дохода**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
RFN		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Наименование головной фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по счетам клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string		
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов		string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	30	
RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	TRADE_NO	Номер сделки в Системе торгов *	+	string	20	0
	OPERATION_NO	Номер операции по начислению дохода в торговой системе	+	string	20	
	TRADE_DATE	Дата заключения сделки	+	date		

## Форматы клиринговых отчетов на фондовом рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	SETTLEDATE1	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО / сделки купли-продажи	+	date		
	SETTLEDATE2	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО / сделки купли-продажи	+	date		
	RECORD_DATE	Дата составления списка лиц, имеющих право на получение дохода	+	date		
	DEBIT/CREDIT	Направленность обязательства по передаче дохода (Обязательство (D) / Требование (C))	+	string		
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
	QUANTITY	Объем сделки, в ценных бумагах	+	decimal	20	0
	PRICE	Доход	+	decimal	38	16
	REFUND_SUM	Сумма обязательства / требования по передаче дохода	+	decimal	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/RFN						
/KASE_DOC						

\* В поле "TradeNo" указывается номер лицевой сделки.

(Данное приложение изменено решением Правления Биржи от 28 июля 2020 года)

## ОТЧЕТ

### о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам

#### Отчет о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам

Дата отчета: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Наименование клирингового участника: \_\_\_\_\_

Торговый код клирингового участника: \_\_\_\_\_

Расчет требований и обязательств клирингового участника по клиринговому гарантийному фонду	Сумма, тенге
Необходимый размер гарантийного вноса:	
для клирингового участника, являющегося банком	
для клирингового участника, не являющегося банком	
Размер гарантийного вноса до начала торгов	
Сумма, использованная Биржей из гарантийного вноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Сумма, использованная Биржей из гарантийного вноса для покрытия обязательств несостоятельных клиринговых участников	
Размер гарантийного вноса по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению гарантийного вноса	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению гарантийного вноса до необходимого размера должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_

Расчет обязательств клирингового участника по клиринговому резервному фонду	Сумма, тенге
Размер клирингового резервного фонда до начала торгов	
Сумма, использованная Биржей из клирингового резервного фонда для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Размер клирингового резервного фонда по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению клирингового резервного фонда	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению клирингового резервного фонда должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_

**Приложение 7**

к Форматам клиринговых отчетов  
на фондовом рынке

*(Данное приложение включено решением Правления Биржи от 17 января 2020 года)*

**ОТЧЕТ**

**по сделкам, вошедшим в клиринг на нетто основе**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
CNT		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор головной фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Клирингового участника	+	string	12	
BOARD		Блок данных по режиму торгов				
	BOARD_ID	Идентификатор режима торгов	+	string	4	
	BOARD_NAME	Наименование режима торгов	+	string	30	
CURRENCY		Блок данных по валюте расчетов				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценной бумаге				
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
RECORDS		Блок данных по сделке				

**Форматы клиринговых отчетов на фондовом рынке**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	TRADE_NO	Номер сделки в торгово-клиринговой системе ASTS+	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Дата торгов	+	date		
	BUY_SELL	Направленность сделки / части сделки (покупка (B) / продажа (S))	+	string	1	
	SETTLECODE	Код расчетов по сделке	+	string	6	
	TRADE_TYPE	Тип сделки	+	string	1	
	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Объем сделки в ценных бумагах / иностранной валюте	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Объем сделки в деньгах	+	decimal	20	2
SETTLE		Блок информации по расчетам				
	SETTLEDATE	Фактическая дата расчетов	+	date		
	SETTLETIME	Время расчетов	+	time		
	SESSION_NO	Номер клиринговой сессии	+	integer	1	
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNT						
/KASE_DOC						