

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н ы
решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол заседания
от 24 ноября 2020 года № 155)

Вводятся в действие
с 30 ноября 2020 года

ФОРМАТЫ клиринговых отчетов на валютном рынке

г. Алматы
2020

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменение № 1:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 15 декабря 2020 года № 164);
- введено в действие с 20 декабря 2020 года.

Настоящие Форматы клиринговых отчетов на валютном (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 валютного 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.kz¹.
3. Клиринговые отчеты фондового рынка являются электронными документами, сформированными в формате XML (приложения 1, 2, 3, 4, 5, 6) и PDF (приложение 7).
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.

¹ 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 валютном рынке

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*		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		
		2 – клиринговая сессия для расчетов по CNY				
		3 – клиринговая сессия для расчетов с Провайдерами ликвидности по CNY				
		4 – основная клиринговая сессия для расчетов по T0				
		5 – дополнительная клиринговая сессия				
		6 – клиринговая сессия с недобросовестными клиринговыми участниками				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
GROUP		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Участника торгов		string	12	
CURRENCY						
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	2
SETTLE						
	DEBIT	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2

Форматы клиринговых отчетов на валютном рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CREDIT	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT						
/KASE_DOC						

* TNT_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.

Приложение 2

к Форматам клиринговых отчетов
на валютном рынке

(Данное приложение изменено решением Правления Биржи от 15 декабря 2020 года)

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				
TNTFINx		Блок данных отчета				
	TODAYDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
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	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
SETTLE		Блок данных по расчетным обязательствам / требованиям по сделкам				
	NETTO_FOREX	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Нетто-требование / нетто-обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	NETTO_VARMARGIN	Нетто-требование / нетто-обязательство по вариационной марже	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Итоговое нетто-требование или нетто-обязательство	+	decimal	20	2

Форматы клиринговых отчетов на валютном рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNTFINfx						
/KASE_DOC						

Приложение 3

к Форматам клиринговых отчетов
на валютном рынке

ОТЧЕТ

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

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNFfx*		Блок данных отчета				
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				
	TRADEDATE	Дата расчетов	+	datetime		
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "CASH" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "SECURITY" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по финансовым инструментам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по финансовым инструментам				
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				

Форматы клиринговых отчетов на валютном рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CREDIT_SWAP	Обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	DEBIT_SWAP	Требование по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Нетто-требование / нетто-обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	CREDIT_BUYSELL	Обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	DEBIT_BUYSELL	Требование по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	NETTO_BUYSELL	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	CREDIT_DEF	Обязательство по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	DEBIT_DEF	Требование по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	NETTO_DEF	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Итоговое нетто-требование или нетто-обязательство	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNFfx						
/KASE_DOC						

* TNFfx – кодировка отчета о будущих нетто для расчетной клиринговой сессии.

Приложение 4

к Форматам клиринговых отчетов
на валютном рынке

ОТЧЕТ
о margin-call

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
MRCfx		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	Торговый код Участника торгов		string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Сумма Маржинального требования, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						
/MRCfx						
/KASE_DOC						

*MRCfx – кодировка отчета о margin-call.

Приложение 5

к Форматам клиринговых отчетов
на валютном рынке

ОТЧЕТ

по сделкам, вошедшим в клиринг

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
CNTfx		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	
SECURITY		Блок данных по финансовому инструменту				
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование финансового инструмента		string	0-120	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	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	
	PRICE	Курс сделки. Для операций с иностранной валютой / операций своп цена сделки открытия или сделки закрытия.	+	decimal	20	6

Форматы клиринговых отчетов на валютном рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	QUANTITY	Объем сделки в количестве финансовых инструментов	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Объем сделки в деньгах, в валюте расчетов	+	decimal	20	2
SETTLE		Блок информации по расчетам				
	SETTLEDATE	Фактическая дата расчетов	+	date		
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNTfx						
KASE_DOC						

* CNTfx – кодировка отчета по сделкам, вошедшим в клиринг на нетто основе.

Приложение 6

к Форматам клиринговых отчетов
на валютном рынке

ОТЧЕТ

об обязательствах/ требованиях по уплате вариационной маржи

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
VMR		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	Торговый код Участника торгов		string	12	
SECURITY		Блок данных по финансовому инструменту				
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование финансового инструмента		string	0-120	
SETTLEDATE		Блок данных по Дате исполнения				
	SETTLEDATE	Дата исполнения	+	dateTime		
RECORDS		Блок данных по обязательствам / требованиям по сделкам с производными финансовыми инструментами валютного рынка				
	PREVIOUS_SETTLE_PRICE	Предыдущая расчетная цена (для сделок, заключенных раньше предыдущего торгового дня) / Цена сделки (для сделок, заключенных в предыдущий торговый день)		number	20	6
	PREVIOUS_QUANTITY	Количество базового актива в предыдущий торговый день		number	20	2
	PREVIOUS_TRADE_VOLUME	Объем сделки в предыдущий торговый день		number	20	2
	CURRENT_SETTLE_PRICE	Текущая расчетная цена сделки		number	20	6

Форматы клиринговых отчетов на валютном рынке

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CURRENT_QUANTITY	Количество базового актива в текущий торговый день		number	20	2
	CURRENT_TRADE_VOLUME	Объем сделки в текущий торговый день		number	20	2
	VARIATION_MARGIN	Обязательство/ Требование по уплате вариационной маржи (указывается со знаком)		number	20	2
/RECORDS						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/SETTLE						
/FIRM						
/VMR						
/KASE_DOC						

* VMR – кодировка отчета об обязательствах/ требованиях по уплате вариационной маржи.

Приложение 7

к Форматам
клиринговых отчетов
на валютном рынке

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 взноса	
Размер гарантийного взноса до начала торгов	
Сумма, использованная Биржей из гарантийного взноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Сумма, использованная Биржей из гарантийного взноса для покрытия обязательств несостоятельных клиринговых участников	
Размер гарантийного взноса по итогам торгов	
Обязательства/ требования по гарантийному взносу: '+' – обязательства '-' – требования	

Обязательство клирингового участника по восстановлению гарантийного взноса 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 _____