

# "ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

---

---

"Қазақстан қор биржасы" АҚ  
Басқармасының шешімімен  
(2021 жылдың 02 шілдесіндегі  
№ 66 отырыс хаттамасы)

**б е к і т і л д і**

2021 жылдың 07 шілдесінен бастап  
**қолданысқа енгізілді**

## Деривативтер нарығындағы клирингілік есептердің ФОРМАТТАРЫ

Осы форматтар клирингілік қызметті жүзеге асыруды реттейтін "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) ішкі құжаттарына сәйкес әзірленген және клирингілік қатысушыларға ұсынылатын есептердің нысандары мен форматтарын сипаттайды.

1. Осы форматтарда, Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның ішкі құжаттарында айқындалған, ұғымдар мен терминдер пайдаланылады.
2. Деривативтер нарығының клирингілік есептері Биржаның "орталық контрагентпен мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті" ішкі құжатында белгіленген тәртіппен клирингілік жүйеде қалыптастырылады және клирингілік қатысушыларға электрондық құжаттар алмасу жүйесі eTransfer.kz<sup>1</sup> арқылы жіберіледі.
3. Деривативтер нарығының клирингілік есептері XLS, XML (1, 2-қосымшалар) және PDF (3-қосымша) форматында қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады.
4. XLS, XML форматындағы деривативтер нарығының әрбір клирингілік есебінде мәтіндік жолдар түріндегі тақырып және деректері бар жолдар болып табылатын мазмұндық бөлік бар.
5. XML форматындағы туынды қаржы құралдар нарығының әрбір клирингілік есебі келесілерге түрлендірілуі мүмкін:

алушыға ыңғайлы кез келген формат (оның ішінде бөлгіштері бар TXT форматы) өзінің БЭК-офистік бағдарламалық құралдарымен және/немесе стандартты бағдарламалық құралдармен (MS Excel) өңдеу жолымен;

Microsoft Internet Explorer-де файлды ашу арқылы баспа түрінде.

---

<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.

Деривативтер нарығындағы  
клирингілік есептердің  
форматтарына

1 қосымша

**Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоттарының жайғасымдық жай-күйі туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттем	Түрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түбірлік элементі (root element)				
FUTPOS*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректерінің блогы				
	account	Клирингілік қатысушының сауда-саттық коды	+	string	120	
ISIN						
	isin	Қаржы құралының символдық коды	+	string	10	
SETTLE						
	pos_beg	Күннің басындағы жайғасым	+	decimal	20	2
	pos_end	Күннің соңындағы жайғасым	+	decimal	20	2
FEE						
	fee	Клиент/фирма және қаржы құралы үшін жиынтық алым				
	fee_ex	Биржалық алым		decimal	20	2
	fee_cc	Клирингілік алым		decimal	20	2
VM						

Форматы клиринговых отчетов на рынке деривативов

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттем	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
	vm	Түрлендірілмелі маржа				
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/ISIN						
/FIRM						
/FUTPOS*						
/KASE_DOC						

\* *FUTPOS\_ – есеп айырысу клирингілік сессия үшін есепті кодтау.*

Деривативтер нарығындағы  
клирингілік есептердің  
форматтарына

**2 қосымша**

**Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоттарының ақшалай жай-күйі туралы**

**ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттем	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түбірлік элементі (root element)				
FUTMON*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректерінің блогы				
	account	Клирингілік қатысушының сауда-саттық коды	+	string	120	
SETTLE						
	amount_beg	Күннің басындағы ақша	+	decimal	20	2
	pay	Шот бойынша қозғалыс	+	decimal	20	2
	amount_end	Күннің соңындағы ақша				
FEE						
	go	Фьючерстер бойынша жиынтық ГО				

Форматы клиринговых отчетов на рынке деривативов

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттем	Тұрпаты	Көлемі	Ондық таңбалар
	fee_fut	Фьючерстік биржалық алым		decimal	20	2
VM						
	vm	Түрлендірілмелі маржа				
LIMIT						
	free					
/LIMIT						
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/FIRM						
/FUTMON*						
/KASE_DOC						

\* *FUTMON\_ – есеп айырысу клирингілік сессия үшін есепті кодтау*

Деривативтер  
нарығындағы  
клирингілік есептердің  
форматтарына

**3 қосымша**

**Клирингілік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы**

**Е С Е П**

Есеп күні: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының атауы: \_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының сауда-саттық коды: \_\_\_\_\_

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

**Клирингілік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі** \_\_\_\_\_

Клирингілік қатысушының клирингілік резервтік қор бойынша міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Клирингілік резервтік қордың сауда-саттық басталғанға дейінгі мөлшері	
Клирингілік қатысушының меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингілік резервтік қордан Биржа пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингілік резервтік қордың мөлшері	
Клирингілік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

**Клирингілік қатысушының клирингілік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мына мерзімге дейін орындалуы тиіс** \_\_\_\_\_