

"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

Қор нарығында клирингілік есептердің ФОРМАТТАРЫ

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. № 1 толықтыру:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен (2020 жылдың 17 қаңтарындағы № 4 отырыс хаттамасы);
- 2020 жылдың 20 қаңтарынан бастап қолданысқа енгізілді.

2. № 2 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен (2020 жылдың 28 шілдесіндегі № 103 отырыс хаттамасы);
- 2020 жылдың 29 шілдесінен бастап қолданысқа енгізілді.

Қор нарығындағы клирингілік есептедің осы форматтары (бұдан әрі – Форматтар) "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) клирингілік қызметті жүзеге асыруды реттейтін ішкі құжаттарына сәйкес әзірленіп, клирингілік қатысушыларға ұсынылатын есептердің нысанын және форматтарын сипаттайды.

1. Осы Форматтарда Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның басқа да ішкі құжаттарында анықталған, ұғымдар мен терминдер қолданылған.
2. Қор нарығының клирингілік есептері, "Орталық контрагентпен жасалған мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті" атты Биржаның ішкі құжатында белгіленген, тәртіпте клирингілік жүйеде қалыптастырылып, eTransfer.kz¹ электрондық құжатайналым жүйесі арқылы клирингілік қатысушыларға жолданады (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2020 жылдың 28 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
3. Қор нарығының клирингілік есептері XML форматында (1, 2, 3, 4, 5, 7 қосымшалар) және PDF форматында (6 қосымша) қалыптастырылған, электрондық құжаттар болып табылады (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2020 жылдың 28 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
4. Қор нарығының XML форматындағы әр бір клирингілік есебінің мәтінді жолдардан тұратын тақырыптамасы және мәліметтерді қамтитын мазмұндық бөлімнен тұрады.
5. Қор нарығының XML форматындағы клирингілік есебі келесідей өзгертілуі мүмкін:
Алушы үшін ыңғайлы болатын бэк-офистің меншікті бағдарламалық құралдарымен және/немесе стандартты бағдарламалық құралдармен (MS Excel) өңдеу арқылы алынған, кез келген формат (соның ішінде ажыратқыштары бар TXT форматы);
Microsoft Internet Explorer-де ашу арқылы алынған басылымыдың форматта.

¹ Биржа мен клирингілік қатысушының арасындағы кепілдендірілген жеткізілім және криптографиялық қорғаныс құралдары арқылы жіберілетін деректердің құпиялығы мен түзетілмеуін қамтамасыз ететін электрондық құжат айналымының мамандандырылған жүйесі.

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына
1 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

АЛДЫН АЛА ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
TNT_Ses1_PRE *		Есептердің мәліметтер блогы				
	TRADEDATE	Есеп құрастырылатын, дата	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп құрастырылған, есептесу клирингілік сессиясының реттік нөмірі "1" – 15:30-дағы клирингілік сессия "2" – 17:30-дағы клирингілік сессия		integer		
FIRM		Фирма мәліметтерінің блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендірушісі	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпараттар блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингілік қатысушының жайғасымдары бойынша ақпараттар блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса – тіркелген нодтарда ақшалай жайғасымдар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады, егер "S" болса – бағалы қағаздар бойынша и нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша мәліметтер блогы				

Қор нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
	CURRENCY_ID	Есептесу валютасының сәйкестендірушісі	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есептесу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша мәліметтер блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздардың сәйкестендірушісі	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	Бағалы қағаздың ISIN	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша мәліметтер блогы				
	DEBIT_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_PRE *						
/KASE_DOC						

* TNT_Ses1_PRE – бірінші есептесу клирингілік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау;

TNT_Ses2_PRE – екінші есептесу клирингілік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау.

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына
2 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері

Қ О Р Ы Т Ы Н Д Ы Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element) документа				
TNT_Ses1_FIN *		Есеп мәліметтерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын, дата	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы алдын ала есеп қалыптастырылған, клирингілік сессияның реттік нөмірі		integer		
		"1" – 15:30-дағы клирингілік сессия				
		"2" – 17:30-дағы клирингілік сессия				
FIRM		Фирманың мәліметтер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендірушісі	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты туралы ақпараттар блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингілік қатысушының жайғасымдары бойынша ақпараттар блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса – тіркелген нодтарда ақшалай жайғасымдар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады, егер "S" болса – бағалы қағаздар бойынша және нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша мәліметтер блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
	CURRENCY_ID	Есептесу валютасының сәйкестендірушісі	+	string	4	

Қор нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
	CURRENCY_NAME	Есептесу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша мәліметтер блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың сәйкестендірушісі	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	Бағалы қағаздың ISIN	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша мәліметтер блогы				
	DEBIT_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша міндеттемелер	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша талаптар	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Жартылай қамтылған мәмілелер бойынша нетто-талаптар/нетто-міндеттемелер	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_FIN *						
/KASE_DOC						

* TNT_Ses1_FIN – бірінші есептесу клирингілік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау;

TNT_Ses2_FIN – екінші есептесу клирингілік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау.

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына
3 қосымша

**Margin-call туралы
ЕСЕП**

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element)				
MRC		Есеп мәліметтерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын, дата	+	dateTime		
FIRM		Фирманың мәліметтер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендірушісі	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда-саттық коды бойынша ақпараттар блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Клирингілік қатысушының негізгі ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Margin-call сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						
/MRC						
/KASE_DOC						

* Екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттарға байлау үшін қолданылады.

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына
4 қосымша

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

Е С Е П

(Осы тақырыптама Биржа Басқармасының 2020 жылдың 28 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
TNF		Есеп мәліметтерінің блогы				
FIRM		Фирманың мәліметтер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендірушісі	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
POSTYPES		Ақшалай жайғасым немесе депозиттік бөлім бойынша ақпараттар блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса – тіркелген нодтарда ақшалай жайғасымдар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады, егер "S" болса – бағалы қағаздар бойынша және нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады	+	string		
GROUP		Блок данных по счетам клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша мәліметтер блогы				
	CURRENCY_ID	Есептесу валютасының сәйкестендірушісі		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есептесу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша мәліметтер блогы				

Қор нарығындағы клирингтік есептердің форматтары

	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың сәйкестендірушісі	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	10	
	ISIN	Бағалы қағаздың ISIN		string	12	
	DEBIT_NETTO_Y0	Нетто-міндеттеме / міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_NETTO_Y0	Нетто-талап / талап	+	decimal	20	2
	SETTLEDATE	Орындау датасы	+	date		
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/POSTYPES						
/FIRM						
/TNF						
/KASE_DOC						

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына
5 қосымша

Кірістерді беру бойынша міндеттемелер / кірістерді алу бойынша талаптар туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Мөлше рі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element).				
RFN		Есеп мәліметтерінің блогы				
FIRM		Фирманың мәліметтер блогы				
	FIRM	Фирманың сәйкестендірушісі	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Бас фирманың атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушылардың шоттары бойынша ақпараттар блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай жайғасымының коды	+	string	12	
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса – тіркелген нодтарда ақшалай жайғасымдар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады, егер "S" болса – бағалы қағаздар бойынша және нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпараттар мазмұндалады	+	string		
CURRENCY		Валюта бойынша мәліметтер блогы				
	CURRENCY_ID	Есептесу валютасының сәйкестендірушісі		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есептесу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша мәліметтер блогы				
	TRADE_NO	Сауда-саттық жүйесіндегі мәміленің нөмірі*	+	string	20	0
	OPERATION_NO	Сауда-саттық жүйесінде кірістерді есепке қосу бойынша операцияның нөмірі	+	string	20	

Қор нарығындағы клирингтік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Мөлше рі	Ондық таңбалар
	TRADE_DATE	Мәміленің жасалған күні	+	date		
	SETTLEDATE1	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 1-ші бөлігін орындау датасы	+	date		
	SETTLEDATE2	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 1-ші бөлігін орындау датасы	+	date		
	RECORD_DATE	Кірістер алуға құқылы, тұлғалардың тізімі жасалған күн	+	date		
	DEBIT/CREDIT	Кірістер беру бойынша міндеттемелердің бағыттылығы (Міндеттеме (D) / Талап (C))	+	string		
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың сәйкестендірушісі	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	Бағалы қағаздың ISIN	+	string	20	
	QUANTITY	Мәміленің көлемі, бағалы қағаздармен	+	decimal	20	0
	PRICE	Кіріс	+	decimal	38	16
	REFUND_SUM	Кірісті беру бойынша міндеттеменің / талаптың сомасы	+	decimal	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/RFN						
/KASE_DOC						

* "TradeNo" өрісінде жеке мәміленің нөмірі көрсетіледі.

Қор нарығындағы
клирингілік есептердің
форматтарына

6 қосымша

(Биржа Басқармасының 2020 жылдың 28 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)

**Клирингілік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы
ЕСЕП**

Клирингілік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы есеп

Есептің датасы: _____

№ _____

Клирингілік қатысушының атауы: _____

Клирингілік қатысушының сауда-саттық коды: _____

Клирингілік кепілдік қоры бойынша клирингілік қатысушының талаптары мен міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Кепілдік жарнаның қажетті мөлшері:	
банк болып табылатын, клирингілік қатысушы үшін	
банк болып табылмайтын, клирингілік қатысушы үшін	
Сауда-саттық басталғанға дейін кепілдік жарнаның мөлшері	
Клирингілік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін Биржа кепілдік жарнадан пайдаланған, сома	
Дәрменсіз клирингілік қатысушылардың міндеттемелерін жабу үшін Биржа кепілдік жарнадан пайдаланған, сома	
Сауда-саттық қорытындысы бойынша кепілдік жарнаның мөлшері	
Кепілдік жарнаны қалпына келтіру бойынша міндеттеме	

Клирингілік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшеріне дейін толықтыру бойынша міндеттемесі келесі мерзімге дейін орындалуы тиіс

Клирингілік қатысушының клирингілік сақтық қоры бойынша міндеттемелерін есептеу	Сумма, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейін клирингілік сақтық қордың мөлшері	
Клирингілік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін Биржа сақтық қордан пайдаланған, сома	
Сауда-саттық қорытындысы бойынша клирингілік сақтық қордың мөлшері	
Клирингілік сақтық қорды қалпына келтіру бойынша міндеттеме	

Клирингілік қатысушының клирингілік сақтық қорды қалпына келтіру бойынша міндеттемесі келесі мерзімге дейін орындалуы тиіс

Қор нарығындағы клирингілік есептердің форматтары

Қор нарығында клирингілік есептердің
форматтарына

7 қосымша

(Осы қосымша Биржа Басқармасының 2020 жылдың 17 қаңтарындағы шешімімен енгізілген)

Нетто негіздегі клирингке кірген мәмілелер бойынша

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
KASE_DOC		XML құжатының түпкі элементі (root element).				
CNT		Есеп мәліметтерінің блогы				
FIRM		Фирманың мәліметтер блогы				
	FIRM	Идентификатор головной фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-саттық коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық тәртіптемесі бойынша мәліметтер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық тәртіптемесінің сәйкестендірушісі	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық тәртіптемесінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Есептесу валютасы бойынша мәліметтер блогы				
	CURRENCY_ID	Есептесу валютасының сәйкестендірушісі	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есептесу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша мәліметтер блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың сәйкестендірушісі	+	string	12	

Қор нарығындағы клирингтік есептердің форматтары

Ноданың атауы	Атрибуттың атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Тұрпаты	Мөлшері	Ондық таңбалар
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	Бағалы қағаздың ISIN	+	string	20	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TRADE_NO	Мәміленің ASTS+ сауда-клирингтік жүйесіндегі нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		
	BUY_SELL	Мәміленің / мәміленің бір бөлігінің бағытталуы (сатып алу (B) / саты (S))	+	string	1	
	SETTLECODE	Мәміле бойынша есептесу коды	+	string	6	
	TRADE_TYPE	Мәміленің тұрпаты	+	string	1	
	PRICE	Бір бағалы қағаздың бағасы	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Бағалы қағаздармен / шетел валютасымен мәміленің көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Мәміленің ақшалай көлемі	+	decimal	20	2
SETTLE		Есептесу бойынша ақпараттар блогы				
	SETTLEDATE	Есептесудің нақты күні	+	date		
	SETTLETIME	Есептесу уақыты	+	time		
	SESSION_NO	Клирингтік сессияның нөмірі	+	integer	1	
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNT						
/KASE_DOC						