

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

---

**У т в е р ж д е н**

решением Правления  
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания  
от 29 декабря 2015 года № 144)

**Введен в действие**

с 01 января 2016 года

## РЕГЛАМЕНТ работы клиринговой системы

---

---

г. Алматы

2015 год

## **ЛИСТ ПОПРАВК**

### **1. Дополнения и изменения № 1:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 декабря 2016 года № 130);
- введены в действие с 01 января 2017 года.

Настоящий Регламент определяет порядок работы клиринговой системы при осуществлении АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами.

## Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Понятия, используемые в настоящем Регламенте, идентичны понятиям, которые определены Правилами осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами<sup>1</sup> (далее – Правила клиринга) и иными внутренними документами Биржи (*данный пункт дополнен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).
2. Ежедневно по результатам торговых сессий Биржа проводит клиринговые сессии по сделкам с финансовыми инструментами для определения нетто-обязательств и/или нетто-требований каждого клирингового участника.
3. Биржа проводит клиринговые сессии по всем сделкам, заключенным с финансовыми инструментами, указанными в приложении 1 к Правилам клиринга (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).
4. Время работы клиринговой системы, в течение которого осуществляются все необходимые процедуры клиринговой системы, начинается с 09.00 времени города Астаны и заканчивается в 19.00 времени города Астаны (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).
5. Биржа проводит клиринговые сессии:
  - 1) по сделкам на рынке деривативов – с 15.30 до 16.00 времени города Астаны;
  - 2) по сделкам на валютном рынке:
    - утреннюю клиринговую сессию – с 11.00 до 11.30 времени города Астаны;
    - дневную клиринговую сессию – с 15.30 до 16.00 времени города Астаны;
    - вечернюю клиринговую сессию – с 17.00 до 17.30 времени города Астаны;
  - 3) по сделкам на фондовом рынке – с 17.30 до 19.00 времени города Астаны (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).
6. Время проведения клиринговых сессий может быть изменено Председателем Правления Биржи или заместителем Председателя Правления Биржи, курирующим клиринговую деятельность на Бирже, в случаях сбоя в работе программно-технических средств, которые используются при проведении клиринговых сессий, выявления обстоятельств, препятствующих проведению клиринговых сессий в обычном режиме, или иных обстоятельств (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).

## Глава 2. ПРОЦЕДУРЫ КЛИРИНГОВОЙ СИСТЕМЫ В ТЕЧЕНИЕ ТОРГОВОГО ДНЯ

7. Ежедневно до 09.15 времени города Астаны клиринговое подразделение Биржи получает от подразделения Биржи, осуществляющего расчет индикаторов фондового рынка, посредством средств электронного обмена сообщениями определенные согласно Методике оценки ценных бумаг<sup>2</sup> данные о расчетных ценах акций, входящих в список финансовых инструментов фондового рынка, по сделкам с которыми Биржа осуществляет клиринговую деятельность (*данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года*).

---

<sup>1</sup> Утверждены решением Биржевого совета (протокол заседания от 08 апреля 2015 года № 7).

<sup>2</sup> Утверждена решением Биржевого совета (протокол заседания от 31 марта 2011 года № 7).

8. Ежедневно до 10.00 времени Астаны клиринговая система передает в торговую систему Биржи информацию о:
  - 1) риск-параметрах финансовых инструментов (ставках начальной маржи и лимитах изменения цен, а также для деривативов – ставках начальной маржи по группе деривативов), рассчитанных в соответствии с Методикой расчета риск-параметров финансовых инструментов<sup>3</sup> *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*;
  - 2) расчетных ценах акций, указанных в пункте 7 настоящего Регламента;
  - 3) расчетных ценах деривативов, установленных согласно Правилам клиринга *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*;
  - 4) позициях и/или деньгах на счетах (собственных или клиентских) клиринговых участников по категории "клиринговый участник рынка деривативов" *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*;
  - 5) позициях клиринговых участников по категории "клиринговый участник рынка деривативов" (при наличии);
  - 6) неисполненных обязательствах по маржевым взносам клиринговых участников по категории "клиринговый участник рынка деривативов" (при наличии).
9. Информация, указанная в пункте 8 настоящего Регламента, предоставляется по формам, установленным внутренним документом Биржи о форматах сообщений клиринговой системы<sup>4</sup> *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*.
10. В течение торгового дня при увеличении остатка на маржевом счете клирингового участника по категории "клиринговый участник рынка деривативов" клиринговая система автоматически передает в торговую систему информацию о новом остатке на маржевом счете данного клирингового участника по форме, установленной внутренним документом Биржи о форматах сообщений клиринговой системы.

### **Глава 3. ПРОЦЕДУРЫ КЛИРИНГОВОЙ СИСТЕМЫ ПО РЕЗУЛЬТАТАМ ТОРГОВЫХ СЕССИЙ**

11. Ежедневно после окончания каждой торговой сессии информация обо всех заключенных сделках и о заявках на заключение сделок с финансовыми инструментами автоматически экспортируется из торговой системы в клиринговую систему *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*.
12. В случае изменения ставок лимита изменения цены, а также ставок начальной маржи, в ходе торговой сессии, торговая система после окончания торговой сессии автоматически передает в клиринговую систему информацию о новых ставках *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*.
13. В ходе проведения клиринговой сессии по сделкам на рынке деривативов клиринговая система осуществляет следующие процедуры:
  - 1) определение расчетной цены каждого дериватива в порядке, определенном Правилами клиринга;
  - 2) определение нетто-требований и/или нетто-обязательств клиринговых участников с применением многостороннего неттинга;
  - 3) определение обязательств клиринговых участников по маржевым взносам, гарантийным взносам, и клиринговым сборам;

---

<sup>3</sup> Утверждена решением Правления Биржи (протокол заседания от 29 декабря 2015 года № 144) *(данная сноска включена решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*.

<sup>4</sup> Утверждены решением Правления Биржи (протокол заседания от 31 мая 2012 года № 96) *(данная сноска включена решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года)*.

- 4) определение обязательств клиринговых участников по доведению маржевых и/или гарантийных взносов, в случае недостаточности данных взносов, в соответствии с Правилами клиринга;
- 5) формирование и направление отчетов по результатам клиринговой деятельности клиринговым участникам, расчетному подразделению Биржи и уполномоченному органу<sup>5</sup> в порядке, определенном Правилами клиринга;
- 6) определение неснижаемых остатков на счетах (собственных или клиентских) клиринговых участников;
- 7) выполнение иных процедур, предусмотренных Правилами клиринга.

*(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года).*

14. В ходе проведения клиринговой сессии по сделкам на валютном рынке клиринговая система осуществляет следующие процедуры:

- 1) определение нетто-требований и/или нетто-обязательств клиринговых участников с применением многостороннего неттинга;
- 2) определение обязательств клиринговых участников по гарантийным взносам;
- 3) определение обязательств клиринговых участников по доведению гарантийных взносов, в случае недостаточности данных взносов, в соответствии с Правилами клиринга;
- 4) формирование и направление отчетов по результатам клиринговой деятельности клиринговым участникам, расчетному подразделению Биржи и уполномоченному органу в порядке, определенном Правилами клиринга;
- 5) выполнение иных процедур, предусмотренных Правилами клиринга.

*(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года).*

15. В ходе проведения клиринговой сессии по сделкам на фондовом рынке клиринговая система осуществляет следующие процедуры:

- 1) определение нетто-требований и/или нетто-обязательств клиринговых участников с применением многостороннего неттинга;
- 2) определение обязательств клиринговых участников по маржевому обеспечению (достаточность которого измеряется единым лимитом в соответствии с Правилами клиринга), гарантийным взносам и клиринговым сборам;
- 3) определение обязательств клиринговых участников по доведению маржевого обеспечения и/или гарантийных взносов клиринговых участников в случае недостаточности данных обеспечения и/или взносов, в соответствии с Правилами клиринга;
- 4) формирование и направление отчетов по результатам клиринговой деятельности клиринговым участникам, расчетной организации<sup>6</sup> и уполномоченному органу в порядке, определенном Правилами клиринга;
- 5) выполнение иных процедур, предусмотренных Правилами клиринга.

*(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года).*

16. Информация, указанная в настоящем Регламенте, хранится в клиринговой системе и подлежит ежедневному резервному копированию до 19.00 времени города Астаны *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 28 декабря 2016 года).*

17. Резервные копии обеспечиваются защитой от несанкционированного доступа к информации и хранятся в резервном техническом центре Биржи до их замены обновленными резервными копиями.