

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Басқармасының шешімімен
(2023 жылдың 15 тамызындағы
№ 85 отырыс хаттамасы)

б е к і т і л д і

2023 жылдың 25 қыркүйегінен бастап
қолданысқа енгізілді

Орталық контрагенттің қатысуымен бағалы
қағаздармен мәмілелер жасасу

Т Ә Р Т І Б І

Алматы қ.

2023

Осы Тәртіп Қазақстан Республикасының заңнамасына және "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) жарғысына сәйкес әзірленді және Биржа өткізетін сауда-саттықта орталық контрагенттің қатысуымен бағалы қағаздармен мәмілелер (ОК-мен мәмілелер) жасасу тәртібін анықтайды.

1 тарау. ЖАЛПЫ ҚАҒИДАЛАР

1 бап. Негізгі ұғымдар және шартты белгілер

1. Осы Тәртіпте Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның ішкі құжаттарында анықталған ұғымдар мен шартты белгілер пайдаланылған.
2. Осы Тәртіптің мақсаттары үшін:
 - 1) қаржы құралдары деп орталық контрагенттің қатысуымен сауда-саттық тәртіптемесінде (бұдан әрі – ОК-мен сауда-саттық тәртіптемесі) сауда-саттыққа жіберілген туынды бағалы қағаздарды қоса алғанда, бағалы қағаздар түсініледі;
 - 2) мәміле деп ОК-мен сауда-саттық тәртіптемесінде жасалған қаржы құралдарымен сатып алу-сату мәмілесі (оның ішінде репоны ашу және жабу мәмілесі) түсініледі;
 - 3) өтінім деп ОК-мен сауда-саттық тәртіптемесінде қаржы құралдарымен мәміле жасасуға өтінім түсініледі;
 - 4) сауда-саттыққа қатысушы деп клирингтік ұйым берген клирингтік қатысушы мәртебесіне ие қор санатындағы Биржаның мүшесі түсініледі;
 - 5) есеп айырысу коды деп міндеттемелерді анықтау тәсілін, олардың орындалуын қамтамасыз ету тәсілін, сондай-ақ сауда-клирингтік жүйенің белгілі бір тәртіптемесінде жасалатын мәмілелер бойынша есеп айырысу күнін анықтайтын код түсініледі;
 - 6) "T0" есеп айырысу коды деп өтінім беру кезінде туындайтын міндеттемелерді толық қамтамасыз етуді бақылау процедурасы жүргізілетінін анықтайтын, міндеттемелері нетто-негізде орындалуға жататын ОК-мен мәмілелер жасасу кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі, олар бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру күні осы мәмілелерді жасау күні болып табылады;
 - 7) "Yn" есеп айырысу коды деп өтінім беру кезінде туындайтын міндеттемелерді ішінара қамтамасыз етуді бақылау процедурасы жүргізілетінін, олар бойынша есеп айырысулар T+n ретінде анықталатын күнге келетінін анықтайтын міндеттемелері нетто-негізде орындалуға жататын ОК-мен мәмілелер жасау кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі, мұнда T – мәміле жасалған күн, ал n – есептік жұмыс күндерінің саны;
 - 8) "Ycn" есеп айырысу коды деп өтінім беру кезінде туындайтын міндеттемелерді ішінара қамтамасыз етуді бақылау процедурасы жүргізілетінін, есеп айырысулар T+cn ретінде анықталатын күнге келетінін анықтайтын міндеттемелері нетто-негізде орындалуға жататын ОК-мен репо мәмілелерін жасасу кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі, мұнда T – мәміле жасалған күн, ал cn – репоның жабылу және ашылу күндері арасындағы күнтізбелік күндердің саны;
 - 9) ішінара қамтамасыз ету деп олар бойынша міндеттемелерді орындау сәтіне дейін қамтамасыз етудің жеткіліктілігін бақылау жүзеге асырылатын мәмілелер жасасу шарты түсініледі;

- 10) толық өтеу деп осы жасасуың нәтижесінде туындайтын қаржы құралдарында олар орындалған кезге дейін туындайтын міндеттемелер бойынша толық қамтамасыз етудің болуын тексеру жүзеге асырылатын мәмілелер жасасу шарты түсініледі;
- 11) Клирингілік ережелер деп клиринг қызметін жүзеге асыру тәртібін регламенттейтін клирингілік ұйымының ішкі құжаты түсініледі;
- 12) Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімдері деп Биржаның "ASTS+ сауда-клирингілік жүйесінің сауда-саттық тәртіптемелері мен операцияларының тізімдері" атты ішкі құжаты түсініледі;
- 13) Тізімге енгізу тәртібі деп ішінара қамтамасыз ету шарттарында мәмілелерге жіберілген қаржы құралдарының тізімін қалыптастыру тәртібін регламенттейтін клирингілік ұйымның ішкі құжаты түсініледі;
- 14) Биржалық қызмет ережелері деп Биржаның "Биржалық қызметті жүзеге асыру ережелері" атты ішкі құжаты түсініледі;
- 15) Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелері деп орталық контрагенттің қатысуымен қор нарығында жасалатын бағалы қағаздармен мәмілелер бойынша ақшамен есеп айырысу талаптары мен тәртібін анықтайтын клирингілік ұйымның ішкі құжаты түсініледі;
- 16) Клиринг және есеп айырысу регламенті деп клирингілік ұйымның қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асырудың уақытша тәртібін анықтайтын ішкі құжаты түсініледі.

2 бап.

Мәмілелер жасасу туралы жалпы қағидалар

1. Сауда-клирингілік жүйеде мынадай тәртіптемелер ажыратылады:
 - 1) Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімінде анықталған, бағалы қағаздарды сатып алу-сату мәмілелерін жасау және ОК қатысуымен репо операцияларын жүзеге асыру үшін пайдаланылатын ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелері;
 - 2) Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімдерінде анықталған мәмілелер жасау үшін қамтамасыз етуді қалыптастыру мақсатында ақшамен немесе қаржы құралдарымен қамтамасыз етуді жүзеге асыру немесе ақшамен немесе қаржы құралдарымен қамтамасыз ету шектелімдерін белгілеу үшін пайдаланылатын қамтамасыз ету аударымдарының тәртіптемелері;
 - 3) Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімдерінде анықталған бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы клиентінің мүддесінде ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелерінде жасалған мәмілелер бойынша активтердің нысаналы орналастырылуын бақылау функцияларын жүзеге асыру және талаптар мен міндеттемелердің орындалуын аудару үшін пайдаланылатын есептеулерге аудару тәртіптемелері;
 - 4) клирингілік қызметті жүзеге асыру және ОК функцияларын орындау шеңберінде клирингілік ұйым мәмілелер жасасу және өз атынан немесе сауда-саттыққа қатысушының / клирингілік қатысушының атынан аударым операцияларын жүзеге асыру үшін пайдаланатын технологиялық тәртіптемелер.
2. Түріне қарай ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелерінде сатылатын қаржы құралдары Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімінде белгіленген қаржы құралдарының топтары бойынша бөлінеді.
3. T+ тізіміне кірмейтін қаржы құралдары үшін мәмілелер олар бойынша туындаған нетто-міндеттемелерді қолжетімді T0 есеп айырысу коды бар

толық өтеу шартымен жасалатын ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелері қолжетімді болады.

T+ тізіміне кіретін қаржы құралдары үшін мәмілелер олар бойынша туындайтын нетто-міндеттемелерді ішінара қамтамасыз ету шарттарымен де, сондай-ақ олар бойынша туындайтын нетто-міндеттемелерді қолжетімді Y0, Yn, Ycn, сондай-ақ T0 есеп айырысу кодтарымен толық өтеу шарттарымен жасалатын мәмілелер жасалатын ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелері қолжетімді болады.

Әрбір қаржы құралы Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімдеріне сәйкес ол кіретін қаржы құралдары тобы үшін белгіленген ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелерінде саудаланады.

Биржа Басқармасы осы бағалы қағаз үшін Сауда-саттық тәртіптемелері мен операциялар тізімінде көзделмеген сауда-саттықтың қосымша тәртіптемесінің қандай да бір атауын бағалы қағаз бойынша ашу мүмкіндігі туралы шешім қабылдауға құқылы.

4. Олар бойынша туындайтын нетто-міндеттемелерді ішінара қамтамасыз ету шарттарында жасалатын мәмілелер бойынша қамтамасыз ету ретінде қабылданатын қаржы құралдары Тізімге енгізу тәртібіне сәйкес анықталатын T+ қамтамасыз ету тізіміне кіретін қаржы құралдары болып табылады.

T+ қамтамасыз ету тізіміне кіретін қаржы құралдары Клирингілік ережелерге сәйкес есептелетін қамтамасыз ету ретінде бірыңғай шектелімді есептеуге қатысады.

5. Y0, Yn, Ycn есеп айырысу кодтарымен сауда-саттық тәртіптемелерінде саудаланатын қаржы құралы бойынша нетто-міндеттемелердің орындалуын қамтамасыз етуге қатысты "қысқа сатуға тыйым салу" белгісі белгіленуі мүмкін.
6. Биржа сауда-клирингілік жүйесіне өтінім беру жүзеге асырылатын сауда-саттық тәртіптемесі үшін белгіленген есеп айырысу кодына сәйкес қамтамасыз етуді бақылау процедурасы оң аяқталғаннан кейін ОК-мен мәмілелер жасасуға өтінімдерді жібереді.
7. Сауда-клирингілік жүйеде мәмілелер жасау мақсатында сауда-саттыққа қатысушыларға және бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыларға сауда-клирингілік шоттарды ашу, жүргізу және жабу тәртібін регламенттейтін Биржаның ішкі құжатында белгіленген тәртіппен сауда-клирингілік шоттары ашылады.
8. Орталық депозитариймен электрондық құжаттар алмасуды Орталық депозитариймен жасалған тиісті келісім-шарт негізінде клиринг ұйымы жүзеге асырады.

3 бап.

Сауда-клирингілік шоттар бойынша ақша және қаржы құралдары бойынша позициялар

1. Сауда-клирингілік жүйеде ағымдағы уақыт сәтіндегі жағдай бойынша (әрбір валюта бөлігінде) ақшаны есепке алу үшін сауда-клирингілік шотында ақша бойынша мынадай позициялар пайдаланылады:
 - 1) алдыңғы сауда-саттық күніндегі қалдыққа тең ақша бойынша қалдықты көрсететін кіріс позициясы;
 - 2) ағымдағы позиция "Кіріс" жолының мәні плюс/минус ақшаны сыртқы есепке алу/есептен шығару плюс/минус ақшаның ішкі аударымдары плюс T0 есеп айырысу коды бар мәмілелер бойынша ақша бойынша нетто плюс есеп айырысудың ағымдағы күнімен ішінара қамтамасыз ете отырып, екі тараптан орындалған тікелей мәмілелер есептері бойынша нетто ретінде есептеледі;

- 3) жоспарлы позиция "Ағымдағы" жолының мәні минус T0 есеп айырысу коды бар қаржы құралдарын сатып алуға арналған белсенді өтінімдер және есеп айырысудың ағымдағы күнімен ішінара қамтамасыз ете отырып, сатып алудың тікелей мәмілелері бойынша есептерді орындауға арналған белсенді өтінімдер бойынша ақша бойынша міндеттемелер ретінде есептеледі;
 - 4) есеп айырысу позициясы "Жоспарлы" жолының мәні плюс ағымдағы сауда-саттық күніне келетін есеп айырысу күнімен ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша ақша бойынша нетто ретінде есептеледі;
 - 5) T+ жоспарлы позициясы есеп айырысудың тиісті күніне жоспарлы позицияны көрсетеді, есеп айырысудың алдыңғы күніне T+ жоспарлы позиция плюс есеп айырысудың тиісті күнінің мәмілелері бойынша нетто минус есеп айырысудың тиісті күніне қаржы құралдарын сатып алуға арналған белсенді өтінімдер бойынша міндеттемелер ретінде есептеледі. Есеп айырысудың ағымдағы күні үшін T+ жоспарлы позициясы "Есептік позиция" жолының мәніне тең.
2. Сауда-клиринглік жүйеде ағымдағы уақыттағы жағдай бойынша қаржы құралдарын сауда-клиринглік шотта есепке алу үшін мынадай позициялар пайдаланылады:
- 1) сауда-саттық күні ішінде есепке алуды/есептен шығаруды ескере отырып, Орталық депозитарийдегі қосалқы шоттағы KASE бөліміндегі қаржы құралдарының қалдығы плюс клиринглік сессияның қорытындылары бойынша қаржы құралдары бойынша неттоны көрсететін кіріс позициясы;
 - 2) ағымдағы позиция "Кіріс" жолының мәні плюс T0 есеп айырысу коды бар қаржы құралдары бойынша нетто плюс ағымдағы есеп айырысу күнімен ішінара қамтамасыз ете отырып, екі жақтан орындалған тікелей мәмілелер қаржы құралдары бойынша нетто ретінде есептеледі;
 - 3) жоспарлы позиция "Ағымдағы" жолының мәні минус T0 есеп айырысу коды бар қаржы құралдарын сатып алуға арналған белсенді өтінімдер және есеп айырысудың ағымдағы күнімен ішінара қамтамасыз ете отырып, сатып алудың тікелей мәмілелері бойынша есептерді орындауға арналған белсенді өтінімдер бойынша қаржы құралдары бойынша міндеттемелер ретінде есептеледі;
 - 4) есеп айырысу позициясы "Жоспарлы" жолының мәні плюс ағымдағы сауда-саттық күніне келетін есеп айырысу күнімен ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша қаржы құралдары бойынша нетто ретінде есептеледі;
 - 5) T+ жоспарлы позициясы, есеп айырысудың алдыңғы күніне T+ жоспарлы позициясына тең есеп айырысудың тиісті күніне жоспарлы позиция плюс есеп айырысудың тиісті күнінің мәмілелері бойынша қаржы құралдары бойынша нетто минус есеп айырысудың тиісті күніне қаржы құралдарын сатуға арналған белсенді өтінімдер бойынша міндеттемелер ретінде есептеледі. Есеп айырысудың ағымдағы күні үшін T+ жоспарлы позициясы "Есептік позиция" жолының мәніне тең.
3. Күн сайын сауда-саттық ашылғанға дейін кіріс позициялары бойынша ақпарат сауда-клиринглік жүйесіне:
- 1) тиісті сауда-клиринглік шоттарында (меншікті, клиенттік, клиенттік кастодиандық) көрсету үшін қосалқы шоттарда (меншікті, клиенттік, клиенттік кастодиандық) KASE бөліміндегі қаржы құралдары бойынша клиринглік ұйымған;
 - 2) клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотындағы және сауда-саттыққа қатысушылардың тиісті сауда-клиринглік шоттарында көрсету үшін олардың меншікті, біріктірілген

клиенттік және біріктірілген кастодиандық есеп шоттарында ескерілетін ақшадағы қалдықтар бойынша клирингілік ұйымның есепке алу жүйесінен түседі;

егер сауда-саттыққа қатысушы Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес клирингілік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотында ақшаны сақтау туралы клирингілік ұйымға өтініш берген жағдайда, клиенттік және клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттарындағы ақшадағы қалдықтар туралы ақпарат алдыңғы сауда-саттық күнін жабу нәтижелері бойынша көшіріледі.

Ақшаны сақтау туралы жоғарыда көрсетілген өтініш болмаған жағдайда клиенттік және клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттардағы ақша бойынша кіріс позициялары алдыңғы сауда-саттық күнін жабу нәтижелеріне сәйкес нөлдік мәндерге сәйкес келеді.

4. Сауда-клирингілік жүйесіндегі позициялардың мәндері ақша және қаржы құралдары бойынша позицияларды есептеуге қатысатын кез келген құрауыштардың мәндері әрбір өзгерген кезде нақты уақыт тәртіптемесінде жаңартылады.
5. Сауда-саттыққа қатысушылардың клирингілік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына төлемдері, сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушылардың пайдасына төлемдер Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес жүзеге асырылады.

Сауда-саттыққа қатысушының қосалқы шотындағы KASE бөлімінен (бөліміне) қаржы құралдарын аудару Орталық депозитарий ережелерінің жиынтығына сәйкес жүзеге асырылады.

2 тарау. ОРТАЛЫҚ КОНТРАГЕНТТІҢ ҚАТЫСУЫМЕН МӘМІЛЕЛЕР ЖАСАСУ ТӘРТІБІ

4 бап. Сауда-саттық алдындағы процедураларды жүзеге асыру

1. Күн сайын әр сауда-саттық күнінің 08.00-ден кешіктірмей сауда-клирингілік жүйесіне осы Тәртіптің 3 бабына сәйкес ақша және қаржы құралдары бойынша позицияларды жүктеу жүзеге асырылады.
2. Күн сайын клирингілік ұйым сауда-саттыққа қатысушы клиентінің жеке басын куәландыратын құжаттың қолданылу мерзімі туралы мәліметтерді сауда-клирингілік жүйесіне береді.

Биржа өзінің сауда-клирингілік жүйесі арқылы клирингілік ұйымған алынған мәліметтер негізінде Биржа мүшесі клиентінің жеке басын куәландыратын құжаттың қолданылу мерзімі аяқталғанға дейін күнтізбелік 30 күн бұрын сауда-саттыққа қатысушының клиенттік сауда-клирингілік шоты бойынша мәмілелер жасау мүмкіндігіне тыйым салады.

3. Сауда-саттыққа қатысушы/бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы "L+" біріктірілген клиенттік сауда-клирингілік шотынан және/немесе "K+" біріктірілген клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шотынан ақша бойынша ағымдағы позицияны бөлу мақсатында сауда-клирингілік жүйедегі ақшаны тиісті "I+/"O+" клиенттік сауда-клирингілік шоттарына немесе "C+" клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттарына аударуды жүзеге асырады.

Сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы "кастодиан клиентінің есебінен" сызбасы бойынша мәмілелер жасаған жағдайда бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы қамтамасыз етуге (егер ол ақшамен қалыптастырылса) қойылатын талаптарды орындау үшін шектелімдер белгілеу мақсатында ол тағайындаған сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы мәміле жасасуға өтінім берген кезде сауда-клирингілік жүйеде "C+" сауда-

клиринглік шотынан сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының оған байланыстырылған "I+nBrCu" сауда-клиринглік шотына ақша аударуды жүзеге асырады.

Екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотынан мәмілелер жасалған жағдайда (оның ішінде "брокердің қаражаты есебінен" сызбасы бойынша бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының клиентінің мүддесінде мәмілелер жасасу үшін) сауда-саттыққа қатысушы қамтамасыз етуге (егер ол ақшамен қалыптастырылса) қойылатын талаптарды орындау үшін шектелімдер белгілеу мақсатында өтінімдерді беру кезінде сауда-клиринглік жүйесінде "I+/"S+" сауда-клиринглік шотынан оған байланыстырылған екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотына ақша аударуды жүзеге асырады.

Әрбір "S+", "I+", "C+", "I+nBrCu", "S+2", "O+" сауда-клиринглік шоты бойынша ақша позициясының мәні мәмілелер жасасуға өтінімдер беру мүмкіндігі үшін, сондай-ақ Клиринг және есеп айырысу регламентіне және Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес белгілі бір клиринглік сессия бойынша ақша бойынша нетто-міндеттемелерді орындау үшін қамтамасыз етуге (егер ол ақшамен қалыптасса) қойылатын талаптарды орындау мақсатында белгіленеді.

4. Сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы өзі тағайындаған "кастодиан клиентінің есебінен" сызбасы бойынша мәмілелер жасасуға өтінімдер берген кезде қамтамасыз етуге (егер ол қаржы құралдарымен қалыптастырылса) қойылатын талаптарды орындау үшін шектелімдерді белгілеу мақсатында бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-клиринглік жүйесінде қаржы құралдарын "C+" сауда-клиринглік шотынан оған байланыстырылған "I+BrCu" сауда-клиринглік шотына аударуды жүзеге асырады.

Екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотынан мәмілелер жасалған жағдайда (оның ішінде "брокердің қаражаты есебінен" сызбасы бойынша бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының клиентінің мүддесінде мәмілелер жасасу үшін) сауда-саттыққа қатысушы қамтамасыз етуге (егер ол қаржы құралдарымен қалыптастырылса) қойылатын талаптарды орындау үшін шектелімдер белгілеу мақсатында өтінімдерді беру кезінде сауда-клиринглік жүйесінде қаржы құралдарын оған байланыстырылған "I+/"S+" сауда-клиринглік шотынан оған байланыстырылған екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотына аударуды жүзеге асырады.

Әрбір "S+", "I+", "C+", "I+BrCu", "S+2", "O+" сауда-клиринглік шоты бойынша қаржы құралдары бойынша позицияның мәні мәмілелер жасасуға өтінімдер беру мүмкіндігі үшін, сондай-ақ Клиринг және есеп айырысу регламентіне және Орталық депозитарийдің ережелер жиынтығына сәйкес белгілі бір клиринглік сессия бойынша қаржы құралдары бойынша нетто-міндеттемелерді орындау үшін қамтамасыз етуге (егер ол қаржы құралдарымен қалыптастырылса) қойылатын талаптарды орындау мақсатында белгіленеді.

5 бап.

Берілген өтінімді тексеру және оны қабылдау. Мәміле жасасу

1. Сауда-клиринглік жүйесі автоматтандырылған тәртіптемеде берілген әрбір өтінімді:
 - 1) қаржы құралдары дәліздерінің/репо мөлшерлемелерінің баға шекараларын сақтау;
 - 2) міндеттемелердің орындалуын қамтамасыз етудің жеткіліктілігін сақтау;
 - 3) егер ол сауда-клиринглік жүйенің баптауларында көзделген болса, өтінімде клиент кодының болуы мәніне тексереді.

2. Осы баптың 1 тармағына сәйкес жүргізілген тексерудің нәтижесі теріс болған жағдайда сауда-клиринглік жүйесі өтінімді қабыл алмайды (қабылдамайды).
Сауда-клиринглік жүйесі қабылдамағандардың орнына берілген қайталама өтінімдер де осы баптың 1 тармағына сәйкес тексерілуге жатады.
3. Осы баптың 1 тармағына сәйкес жүргізілген тексерудің нәтижесі оң болған жағдайда сауда-клиринглік жүйесі мұндай өтінімді тіркейді.
4. Сауда-саттыққа қатысушы клиент кодының осындай клиенттің сауда-клиринглік шотына сәйкестігі үшін жауапты болады.
5. Сауда-саттық сессиясы аяқталған сәтте қанағаттандырылмаған өтінімдер Биржаның "ASTS+ сауда-клиринглік жүйесінде сауда-саттық өткізу әдістері туралы қағида" атты ішкі құжатына сәйкес сауда-клиринглік жүйесімен автоматты түрде жойылады.
6. Қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын қамтамасыз ету болып табылатын қаржы құралдарын клиринглік ұйым осы Тәртіптің 6 бабының 4-6 тармақтарында белгіленген ерекшеліктерді ескере отырып пайдалануды шектейді, бұл ретте ақша түріндегі қамтамасыз етуді есепке алу сауда-саттыққа қатысушының әрбір есептік шоты (меншікті, біріктірілген клиенттік, біріктірілген кастодиандық) бойынша клиринглік ұйымның есепке алу жүйесіндегі есептік шоттарында, ал қаржы құралдары түріндегі қамтамасыз етуді басқару – сауда-саттыққа қатысушының Орталық депозитарийдегі қосалқы шоттарындағы (меншікті, клиенттік) KASE бөлімдерінде жүзеге асырылады.
7. Сауда-саттық аяқталғаннан кейін Биржа сауда-саттыққа қатысушыларға және/немесе бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыларға жасалған мәмілелер туралы мәліметтерді және есеп айырысуға аударымдар туралы мәліметтерді қамтитын биржалық куәліктерді ұсынады.
8. Сауда-саттыққа қатысушылар мүшелік жарналардың, биржалық және клиринглік алымдардың құрамын және мөлшерін (мөлшерлемелерін) анықтайтын Биржаның ішкі құжатында белгіленген мөлшерде және тәртіппен комиссиялық алымдарды, Биржа мүшелерінің төлеуіне жататын кепілдік қамтамасыз етуді есепке алғаны үшін комиссияларды төлейді.

6 бап. Сауда-саттық өткізу кезеңінде жүзеге асырылатын процедуралар

1. Сауда-саттық күні ішінде мәмілелер жасасу кезінде қамтамасыз етуге қойылатын талаптарды орындау үшін және/немесе клиринглік сессия басталған уақытқа мәмілелер бойынша міндеттемелерді орындау үшін сауда-саттыққа қатысушылар:
ақшаны – клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына;
қаржы құралдарын – Орталық депозитарийдегі қосалқы шоттардағы (меншікті, клиенттік) KASE бөлімдеріне аударады.
2. Ақша аудару Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес, қаржы құралдарын аудару - Орталық депозитарий ережелерінің жиынтығына сәйкес жүзеге асырылады.
3. Сауда-клиринглік жүйесінде қаржы құралдарының және/немесе ақшаның түсуі туралы мәліметтер алынған кезде мынадай өзгертулер жүзеге асырылады:
 - 1) клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына ақша түскен кезде – әрқайсысының бөлінісінде ақша бойынша ағымдағы позицияның ұлғаюы:
"S+" меншікті сауда-клиринглік шоты;

"L+" біріктірілген сауда-клирингілік шоты, бұл ретте, егер қосалқы шот нөмірі клирингілік ұйымның корреспонденттік шотына ақша аудару үшін негіз болып табылатын төлем құжатының "төлем мақсаты" жолында көрсетілген жағдайда, ақша I+/O+ бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шотына автоматты түрде аударылады;

"K+" біріктірілген клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоты, бұл ретте, егер қосалқы шот нөмірі клирингілік ұйымның корреспонденттік шотына ақша аудару үшін негіз болып табылатын төлем құжатының "төлем мақсаты" жолында көрсетілген жағдайда, ақша C + бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шотына автоматты түрде аударылады;

"I+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты, егер ол жарияланған/сатып алынған бағалы қағаздарды есепке алу үшін эмитент-депоненттің қосалқы шоты болып табылса және қосалқы шоттың нөмірі клирингілік ұйымның корреспонденттік шотына ақша аударуға негіз болып табылатын төлем құжатының "төлем мақсаты" жолында көрсетілсе;

- 2) қаржы құралдары KASE бөлімдеріне түскен кезде – әрқайсысының бөлінісінде қаржы құралдары бойынша кіріс позицияның ұлғаюы:

"S+" меншікті сауда-клирингілік шоты;

"I+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты;

"O+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты;

"C+" бөлектелген клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоты.

Сауда-саттыққа қатысушы/бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы келіп түскен қаржы құралдарымен осы Тәртіптің 4 бабының 3 және 4 тармақтарында көрсетілген іс-әрекеттерді жүзеге асырады.

4. Қандай да бір сауда-клирингілік шотында ескерілетін қаржы құралдары мен ақшаны есептен шығару қажет болған кезде клирингілік күн ішінде мынадай іс-әрекеттер жүргізіледі:

- 1) сауда-клирингілік жүйесі сауда-саттыққа қатысушының пайдасына ақша аудару туралы клирингілік ұйымға келіп түскен өтініш негізінде ақшаны есептен шығаруға сұрау салған кезде мыналардың әрқайсысының бөлінісінде берілген сұрау мөлшерінде ақша бойынша жоспарлы позицияның жеткіліктілігі тексеріледі:

"S+" меншікті сауда-клирингілік шоты;

"L+" біріктірілген сауда-клирингілік шоты;

"K+" біріктірілген клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоты;

"I+", "O+", "C+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты, егер ақшаны есептен шығаруға арналған сұрау салуда "төлем мақсаты" жолында қосалқы шот нөмірі көрсетілген болса.

"S+", "I+", "O+", "C+" сауда-клирингілік шоттары үшін міндеттемелердің орындалуын қамтамасыз етудің жеткіліктілігін қосымша тексеру жүзеге асырылады.

Сауда-саттыққа қатысушы/ бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы ақша бойынша жоспарлы позицияны біріктіру мақсатында сауда-клирингілік жүйесіндегі ақшаны "I+/"O+/"C+" бөлектелген сауда-клирингілік шотынан сауда-саттыққа қатысушыдан біріктірілген шоттан ақша аудару туралы өтініш жіберілгенге дейін тиісті біріктірілген "L+/"K+" сауда-клирингілік шоттарына аударуды жүзеге асырады;

- 2) Орталық депозитарийге келіп түскен сауда-саттыққа қатысушыдан бұйрық немесе уәкілетті мемлекеттік органның немесе лауазымды тұлғаның өкімі негізінде қаржы құралдарына тыйым салу мүмкіндігіне

сұрау салу негізінде қаржы құралдарын KASE бөлімінен есептен шығаруға сұрау түске кезінде Орталық депозитарий клирингілік ұйымға сауда-саттыққа қатысушының жеке шотындағы негізгі бөлімге қаржы құралдарын есептен шығаруға сұрау салуды жібереді.

Клирингілік ұйым берілген сұрау салу мөлшерінде қаржы құралдары бойынша кіріс және жоспарлы позициялардың жеткіліктілігін тексеруді жүзеге асырады, сондай-ақ мыналардың әрқайсысының бөлінісінде міндеттемелердің орындалуын қамтамасыз етудің жеткіліктілігін тексеруді жүзеге асырады:

"S+" меншікті сауда-клирингілік шоты;

"I+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты;

"O+" бөлектелген клиенттік сауда-клирингілік шоты;

"C+" бөлектелген клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоты.

Қаржы құралдары бойынша кіріс және жоспарлы позициялардың жеткіліктілігін тексеру кезінде көрсетілген позициялардың минималдысы жеткілікті болып есептеледі.

5. Клирингілік ұйым осы баптың 4 тармағында көрсетілген тексерулердің нәтижелері бойынша:

1) есептен шығаруға арналған сұрау салуға сәйкес қаржы құралдарын толық мөлшерде есептен шығаруды жүзеге асырады, есептен шығаруға тексерудің нәтижесі оң болған жағдайда сауда-клирингілік шотта ақша бойынша жоспарлы позицияны немесе қаржы құралдары бойынша кіріс позициясын осы мөлшерге азайтады;

2) "максималды ықтимал қалдықты көрсетілгеннен артық емес аудару" белгісімен ақша есептен шығарылған жағдайда белгіленген жеткіліктілік тексерулеріне қойылатын талаптардың орындалуын ескере отырып, есептен шығаруға берілген сұрау салудың барынша рұқсат етілген мөлшерінде ақшаны есептен шығаруды жүзеге асырады және сауда-клирингілік шотындағы ақша бойынша жоспарлы позицияны жүзеге асырылған есептен шығару мөлшерінде азайтады;

3) ақша бойынша жоспарлы позицияның мәні теріс немесе қаржы құралдары бойынша кіріс немесе жоспарлы позицияның мәні теріс болған жағдайда қаржы құралдарын есептен шығарудан бас тартады.

6. Қаржы құралдарын есепке алу/есептен шығару Орталық депозитарийден клирингілік ұйымға түскен есептен шығаруға/есептен шығаруға арналған хабарламаларға сәйкес автоматты тәртіптемеде жүзеге асырылады.

Ақшаны есепке алуды/есептен шығаруды клирингілік ұйым Орталық депозитарийден клирингілік ұйымға келіп түскен есепке алуға арналған хабарламаға және электрондық цифрлық қолтаңбасы бар электрондық құжат түрінде сауда-саттыққа қатысушыдан келіп түскен есептен шығаруға арналған өтінішке сәйкес автоматты тәртіптемеде жүзеге асырады.

3 тарау. БАҚЫЛАУ ЖӘНЕ ҚАМТАМАСЫЗ ЕТУ ЖҮЙЕСІН ПАЙДАЛАНУШЫ КЛИЕНТТЕРІНІҢ МҮДДЕЛЕРІ ҮШІН ОРТАЛЫҚ КОНТРАГЕНТТІҢ ҚАТЫСУЫМЕН МӘМІЛЕЛЕР ЖАСАСУ ЖӘНЕ ОРЫНДАУ

7 бап. "Кастодиан клиентінің есебінен" сызбасы бойынша мәмілелер жасасу

1. "Кастодиан клиентінің есебінен" сызбасы бойынша бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы клиентінің мүддесі үшін сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының ОК-мен мәмілелер жасасуы оған сауда-клирингілік жүйеде рұқсаттама мәмілелер жасау үшін уәкілетті қатысушыға

және бақылау жүйесін пайдаланушыға және олардың орындалуын қамтамасыз ету үшін қамтамасыз ету үшін берілетін екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттан жүзеге асырылады.

2. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы:
 - 1) клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттар бойынша қамтамасыз етуді басқаруды және өтінімдерді беру кезінде қамтамасыз етуге қойылатын талаптарды орындау үшін сауда-саттыққа уәкілетті қатысушылардың екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттарына шектелімдер қоюды;
 - 2) клиенттердің активтерін мақсатты орналастыруды (пайдалануды) бақылауды және оны растау үшін көрсетілген бақылауды бұза отырып жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысуларды сауда-саттыққа уәкілетті қатысушыға аударуды;
 - 3) сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттан жасаған мәмілелер бойынша міндеттемелерді орындауды қамтамасыз етеді.
3. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-клирингілік жүйесі арқылы клиенттердің активтерін мақсатты орналастыруды (пайдалануды) бақылау мақсатында сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы жасасқан мәмілелер параметрлерінің:
 - 1) бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы клиенттің бұйрығымен;
 - 2) Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерімен сәйкестігін салыстырып тексереді.
4. Салыстырып тексерудің нәтижесі оң болған жағдайда бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы Клиринг және есеп айырысу регламентінде белгіленген уақыттан кешіктірмей клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттарда осы сауда-клирингілік шоттар бойынша нетто-міндеттемелерді орындау үшін жеткілікті мөлшерде қаржы құралдарының болуын қамтамасыз етеді. Оларды уақтылы қамтамасыз етпеген жағдайда клирингілік ұйым сауда-саттыққа қатысушының клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттары бойынша мәмілелерді жүзеге асыра отырып, Клиринг қағидаларына сәйкес реттеу процедураларын жүзеге асырады. Клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттарындағы қаржы құралдарын уақтылы қамтамасыз етпегені үшін сауда-саттыққа қатысушының жауапкершілігі Клирингілік ережелерде анықталған.

Салыстырып тексеру нәтижесі теріс болған жағдайда бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы "Есеп айырысуға аударымдар" тәртіптемесінде осы баптың 6 тармағында белгіленген ерекшеліктерді ескере отырып, көрсетілген бақылауды бұза отырып жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысуға аударуды оны растау үшін сауда-саттыққа уәкілетті қатысушыға жүзеге асыруға құқылы.
5. Сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы осы баптың 4 тармағының екінші абзацында көзделген жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысуға аударымды алғаннан кейін аударым жүзеге асырылған есеп айырысуға аудару тәртіптемесі үшін белгіленген қамтамасыз етуді бақылауды ескере отырып, бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыдан өзіне келіп түскен аударымды растайды. Есеп айырысуларға аударым расталған кезде сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының ол растауды жүзеге асыратын сауда-клирингілік шотында есепке алынатын талаптар мен міндеттемелер ұлғаяды, ал есеп айырысуларды аудару жүзеге асырылған бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының сауда-клирингілік шотында ескерілетін талаптар мен міндеттемелер мәміле бойынша аударылатын есеп айырысулар бойынша туындайтын талаптар мен міндеттемелердің тиісті сомаларына азайтылады.

Сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының есеп айырысуға түскен аударымды растауы сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының оларды орындауға сөзсіз келісімін білдіреді.

6. Есеп айырысуға аударымдар мынадай ерекшеліктер ескеріле отырып жүзеге асырылады:

- 1) есеп айырысуларды аударуға қатысатын шоттардың бірі бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыға тиесілі болуға тиіс;
- 2) есеп айырысуға аудару тәртіптемесі сатып алу-сату мәмілесі жасалған немесе репо операциясы жүзеге асырылған сауда-саттық тәртіптемесіне сәйкес келуге тиіс:

"Каст.: К/П-Т0 орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі теңгедегі есеп айырысу валютасымен және Т0 ("Т0 [ҚҚТ¹]", "ОК-мен тікелей К/П") есеп айырысу кодымен сауда-саттық тәртіптемесінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша есеп айырысуға аудару үшін пайдаланылады;

"Каст.: К/П-Т0 USD орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі АҚШ долларындағы есеп айырысу валютасымен және Т0 ("Т0 [ҚҚТ] USD", "ОК-мен USD-ғы тікелей К/П") есеп айырысу кодымен тәртіптемесінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша есеп айырысуға аудару үшін пайдаланылады;

"Каст.: К/П-Т+ орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі теңгедегі есеп айырысу валютасымен және Y2 ("Т+ [ҚҚТ]") есеп айырысу кодымен тәртіптемесінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша есеп айырысуға аудару үшін пайдаланылады. Бұл ретте есеп айырысуға аудару есеп айырысуды жүзеге асыру күніне дейін кез келген күнде жүзеге асырылуы мүмкін;

"Каст.: К/П-Т+ USD орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі АҚШ долларындағы есеп айырысу валютасымен және Y2 ("Т+[ҚҚТ] USD") есеп айырысу кодымен тәртіптемесінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша есеп айырысуларды аудару үшін пайдаланылады. Бұл ретте есеп айырысуға аудару есеп айырысуды жүзеге асыру күніне дейін кез келген күнде жүзеге асырылуы мүмкін;

"Каст.: Репо орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі теңгедегі есеп айырысу валютасымен және Y0/Ycp ("ОК-мен авторепо", "ОК-мен тікелей репо") есеп айырысу кодымен тәртіптемеде жүзеге асырылған репо операцияларын есептеуге аудару үшін пайдаланылады;

"Каст.: USD-мен репо орын. аударым" есеп айырысуға аудару тәртіптемесі АҚШ долларындағы есеп айырысу валютасымен және Y0/Ycp ("ОК-мен USD-ғы авторепо", "ОК-мен USD-ғы тікелей репо") есеп айырысу кодымен тәртіптемеде жүзеге асырылған репо операцияларын есеп айырысуға аудару үшін пайдаланылады;

- 3) егер есеп айырысуға аудару мәміле жасалған күні жүргізілсе, онда мұндай аударым жасалған мәміленің бағытына қарама-қарсы бағытта оны жасаудың барлық параметрлерін автоматты түрде тексерумен, сондай-ақ аударымның дербес енгізілген параметрлеріне сәйкес осындай мәміленің параметрлерін тексерусіз жүзеге асырылуы мүмкін;
- 4) егер есеп айырысуға аудару мәміле жасалған күннен ерекшеленетін кез келген күні жүргізілсе, онда мұндай аударым осындай аударым үшін енгізілген параметрлерге сәйкес осындай мәміленің параметрлерін тексерусіз жүзеге асырылады. Бұл ретте есеп айырысуға аудару белгілі

¹ Мұнда және одан әрі "қаржы құралдарының тобы" деген сөздің аббревиатурасы. Белгілі бір сауда-саттық тәртіптемесінде саудаланатын қаржы құралдары тобының атауына сәйкес келеді.

бір есеп айырысу күнімен белгілі бір қаржы құралымен жасалған бірнеше мәмілелер бойынша нетто-позициялар мөлшерінде жүзеге асырылуы мүмкін;

5) есеп айырысуға аударуға өтінім:

"T+ [ҚҚТ] " және "T+ [ҚҚТ] USD" сауда-саттық тәртіптемелерінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша есеп айырысу жүзеге асырылатын күннің Алматы уақыты бойынша 12:00-ден кешіктірмей;

"T0 [ҚҚТ] " және "T0 [ҚҚТ] USD" сауда-саттық тәртіптемелерінде жасалған сатып алу-сату мәмілесі бойынша Алматы уақыты бойынша 16: 45-тен кешіктірмей;

репо операцияларын есептеуге аудару үшін жақын арадағы клирингілік сессия басталғанға дейін 15 минут бұрын беріледі.

7. Сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы оған бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыдан келіп түскен есеп айырысуға аударымды:

1) ішінара қамтамасыз ету шарттарында (есеп айырысу кодының бірінші символы "Y") сауда-саттық тәртіптемелерінде жасалған/жүзеге асырылған сатып алу-сату мәмілелерін/репо операцияларын есеп айырысуға аудару бойынша жақын арадағы клирингілік сессияның басталуынан;

2) осындай сауда-саттық тәртіптемелерінде жасалған сатып алу-сату мәмілелері бойынша "T0 [ҚҚТ] " және "T0 [ҚҚТ] (USD)" тәртіптемелерінде сауда-саттықтың аяқталуынан кешіктірмей растайды.

8. Есеп айырысуға түскен аударымды растау сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының ОК-мен мәмілелер бойынша міндеттемелерді орындауға сөзсіз келісімін білдіреді.

9. Биржа сауда-саттыққа уәкілетті қатысушының бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушыдан оған келіп түскен есеп айырысуларға аударуды растамағаны үшін жауапты болмайды.

10. Екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шот бойынша сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы жасаған мәмілелер бойынша міндеттемелер мен талаптарды орындау, егер:

1) сауда-саттыққа уәкілетті қатысушы Клиринг және есеп айырысу регламентінде белгіленген уақытқа дейін есеп айырысуға аударуды растамаған;

2) бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-саттыққа уәкілетті қатысушыға есеп айырысуға аударым жібермеген болса, екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шотқа байланыстырылған "С+" сауда-клирингілік шоты бойынша бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының міндеттемелері мен талаптары болып табылады.

11. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының сауда-клирингілік шотында Клиринг және есеп айырысу регламентінде анықталған уақытқа нетто-міндеттемелерді орындау үшін қаржы құралдарының қажетті саны болмаған жағдайда клирингілік ұйым Клирингілік ережелерге сәйкес дефолтты реттеу жөніндегі процедураларды жүзеге асыру шеңберінде осындай сауда-клирингілік шоттан мәмілелер жасауды жүзеге асырады.

8 бап. "Брокердің қаражаты есебінен" сызбасы бойынша мәмілелер жасасу

1. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының клиентінің мүддесі үшін "Брокердің қаражаты есебінен" сызбасы бойынша сауда-саттыққа қатысушының ОК-мен мәмілелер жасасуы оның "S+" меншікті сауда-клирингілік шотынан не бақылау және қамтамасыз ету жүйесін

пайдаланушыға жасалған мәмілені есеп айырысуға аударымен екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотынан жүзеге асырылады.

2. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-саттыққа қатысушының өз клиентінің мүддесі үшін жасалған активтердің мақсатты орналастырылуын және мәмілелердің орындалуын бақылау мақсатында сауда-саттыққа қатысушының "С+" тиісті клиенттік кастодиандық сауда-клиринглік шотына "Есеп айырысуға аударымдар" тәртіптемесінде берілген ОК-мен мәмілелер есебіне аударуды сауда-клиринглік жүйесінде растайды.
3. Есеп айырысуға аудару осы Тәртіптің 7 бабының 6 тармағында белгіленген ерекшеліктер ескеріле отырып жүзеге асырылады.
4. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-клиринглік жүйесінде сауда-саттыққа қатысушыдан есеп айырысуға аударуға өтінімді алғаннан кейін оған келіп түскен аударымды осы Тәртіптің 7 бабының 7 тармағында көрсетілген мерзімде растайды.
5. Есеп айырысуға келіп түскен аударымды растау бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының сатып алу-сату мәмілесі бойынша аударылған міндеттемелерді не есеп айырысуға аудару расталған репо операцияларын орындауға шартсыз келісімін білдіреді.
6. Егер бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы өзіне қарай жіберілген есеп айырысуға аударуды растамаса, сауда-саттыққа қатысушы "S+" сауда-клиринглік шотынан не екінші деңгейдегі "S+2" сауда-клиринглік шотынан жасаған мәміле бойынша міндеттемелер мен талаптарды орындау сауда-саттыққа қатысушының міндеттемелері мен талаптары болып табылады және оның өз қаражаты есебінен орындалады.

4 тарау. МӘМІЛЕЛЕР БОЙЫНША ЕСЕП АЙЫРЫСУЛАР ТУРАЛЫ ЖАЛПЫ ҚАҒИДАЛАР

1. Мәмілелер бойынша есеп айырысу ұйымы:
ақша бойынша – клиринглік ұйым;
қаржы құралдары бойынша – Орталық депозитарий болып табылады.
2. Мәмілелер бойынша міндеттемелерді қамтамасыз етуге қойылатын талаптарды орындау мақсатында, сондай-ақ жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелерді орындау мақсатында сауда-саттыққа қатысушылар Орталық депозитарийде ашылған мынадай шоттарға (шоттар бөлімдеріне):
ақшаны – клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына;
қаржы құралдарын – Орталық депозитарийдегі қосалқы шоттардың KASE бөліміне аударылады.
Сауда-саттыққа қатысушылардың клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына төлемдері, сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушылардың пайдасына төлемдер Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес жүзеге асырылады.
KASE бөлімдеріне қаржы құралдарын аудару Орталық депозитарий ережелерінің жиынтығына сәйкес жүзеге асырылады.
3. Клиринглік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотына түсетін ақша клиринглік ұйымның есепке алу жүйесінде ашылған сауда-саттыққа қатысушылардың меншікті немесе біріктірілген клиенттік немесе біріктірілген кастодиандық есептік шоттарында есепке алынады және тиісті сауда-клиринглік шоттарының ақшасы бойынша ағымдағы позицияларын ұлғайтады.
Сауда-саттыққа қатысушы "L+" біріктірілген клиенттік сауда-клиринглік шотынан және/немесе "K+" біріктірілген клиенттік кастодиандық сауда-клиринглік шотынан ақша

бойынша ағымдағы позицияны бөлу мақсатында сауда-клирингілік жүйесінде ақшаны "I+²"/"O+" тиісті клиенттік сауда-клирингілік шоттарына және "C+" клиенттік кастодиандық сауда-клирингілік шоттарына аударуды жүзеге асырады.

4. Орталық депозитарийдегі KASE бөлімдеріне келіп түсетін қаржы құралдары сауда-клирингілік жүйесіндегі "S+¹"/"O+¹"/"C+" тиісті сауда-клирингілік шоттарындағы қаржы құралдары бойынша кіріс позицияларын автоматты тәртіптемеде ұлғайтады.
5. Есеп айырысу ағымдағы сауда-саттық күніне келетін мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді орындау мақсатында сауда-саттыққа қатысушы Клиринг және есеп айырысу регламентіне сәйкес белгіленген уақытқа сауда-клирингілік жүйеде "S+¹"/"I+¹"/"O+¹"/"C+" сауда-клирингілік шоттары бойынша ақша және қаржы құралдары бойынша есеп айырысу позицияларының оң мәніне әкеп соғатын мөлшерде ақша мен қаржы құралдарының болуын қамтамасыз етуге тиіс.
6. Клирингілік ұйым Клиринг және есеп айырысу регламентіне сәйкес мәмілелер бойынша есеп айырысулар жүзеге асырылатын күні нетто-талаптар мен нетто-міндеттемелердің орындалуын:
 - қаржы құралдарына қатысты Орталық депозитарийдегі KASE бөлімдері бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру мақсатында ақпартізім жіберу арқылы қамтамасыз етеді және Орталық депозитарийге есеп айырысуға жіберілген ведомостің орындалғаны туралы растауды алу негізінде сауда-клирингілік жүйеде "S+¹"/"I+¹"/"O+¹"/"C+" тиісті сауда-клирингілік шоттарындағы қаржы құралдары бойынша кіріс позицияларын өзгертеді;
 - ақшаға қатысты клирингілік ұйымының есептік жүйесіндегі есептік шоттары (меншікті, біріктірілген клиенттік, біріктірілген кастодиандық) арасында есеп айырысуды жүзеге асыру арқылы қамтамасыз етеді және сауда-клирингілік жүйедегі тиісті "S+" сауда-клирингілік шотындағы және "I+¹"/"O+¹"/"C+" сауда-клирингілік шоттарындағы ақша бойынша жоспарлы және есептік позицияларды өзгертеді.

Сауда-клирингілік жүйесіндегі "I+¹"/"O+¹"/"C+" клиенттік бөлектелген сауда-клирингілік шоттарына есептелген ақшаны есептен шығару қажет болған кезде клиринг қорытындылары бойынша сауда-саттыққа қатысушылар сауда-саттыққа қатысушылардың пайдасына ақша аудару туралы өтініш жіберілгенге дейін сауда-клирингілік жүйеде ақшаны "I+¹"/"O+¹"/"C+" бөлектелген сауда-клирингілік шоттарынан тиісті "L+¹"/"K+" біріктірілген сауда-клирингілік шоттарына аудару арқылы ақша бойынша өзгертілген жоспарлы позицияны біріктіруді жүзеге асырады.

7. Соңғы клирингілік-есеп айырысу сессиясының қорытындылары бойынша, егер сауда-саттыққа қатысушы Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес клирингілік ұйымның Орталық депозитарийдегі корреспонденттік шотында өзінің есептік шоттары бойынша ақшаны сақтау туралы өтініш бермеген болса, клирингілік ұйым:
 - 1) сауда-клирингілік жүйедегі осындай сауда-саттыққа қатысушылардың атынан ақшаны оның барлық "I+¹"/"O+¹"/"C+" сегрегацияланған сауда-клирингілік шоттарынан тиісті "L+" немесе "K+" біріктірілген сауда-клирингілік шоттарына қолжетімді ақша қалдықтарының сомаларында біріктіруді қамтамасыз етудің жеткіліктілігін тексеруді ескере отырып жүзеге асырады;
 - 2) Мәмілелер бойынша ақшалай есеп айырысу ережелеріне сәйкес клирингілік ұйымның есептік жүйесіндегі оның есептік шоттарында (меншікті, біріктірілген клиенттік, біріктірілген кастодиандық) есепке алынатын қолжетімді ақша қалдықтарының сомасында клирингілік ұйымға қойылатын оның қорытынды талаптарын төлеуге сауда-саттыққа қатысушының пайдасына төлемді жүзеге асырады.

² Егер сауда-клирингілік шот жарияланған/сатып алынған бағалы қағаздарды есепке алу үшін эмитенттің/депоненттің қосалқы шоты болып табылмаса.

5 тарау. САУДА-САТТЫҚҚА ҚАТЫСУШЫЛАРДЫҢ ОРЫНДАЛМАҒАН МІНДЕТТЕМЕЛЕРІН РЕТТЕУ

8. Сауда-клиринглік жүйесінде сауда-саттыққа қатысушылардың мәмілелері бойынша орындалмаған міндеттемелерді (бұдан әрі – дефолт) реттеу мақсаттары үшін ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелері және технологиялық тәртіптемелер көзделген.
9. Сауда-клиринглік жүйеде сауда-саттыққа қатысушылардың дефолтын реттеу үшін осындай дефолтты реттеу мақсатында сауда-саттыққа қатысушылардың өздері (оның ішінде сауда-саттыққа уәкілетті қатысушылар), сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушылардың немесе бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушылардың атынан әрекет ететін клиринглік ұйым өтінімдер беретін және/немесе мәмілелер жасайтын тәртіптемелер пайдаланылады.
10. Клиринглік ережелерге сәйкес жосықсыз деп танылған сауда-саттыққа қатысушының нетто-міндеттемелерінің дефолтын реттеу үшін позицияны көшіру процедурасы пайдаланылады.

Нетто-міндеттемелердің дефолтын, маржа дефолтын, Клиринглік ережелерге сәйкес дәрменсіз деп танылған сауда-саттыққа қатысушының кепілдік жарнасы бойынша дефолтты реттеу үшін позицияны мәжбүрлеп жабу процедурасы пайдаланылады.

Орталық депозитарий қаржы құралдарын есептен шығарудан/есептеуден бас тарту себебінен Клиринглік ережелерге сәйкес жосықсыз деп танылған сауда-саттыққа қатысушының нетто-міндеттемелерінің дефолтын реттеу үшін клиринглік ұйым қажет болған жағдайда позицияны ауыстыру процедурасын одан әрі қолдана отырып, орындалмаған міндеттемелерді мәжбүрлеп жою процедурасын жүзеге асырады.
11. Позицияларды ауыстыру процедурасы Клиринглік ережелерге сәйкес клиринглік сессияларды өткізу кезеңінде репо операцияларын және/немесе своп операцияларын жасау арқылы жүзеге асырылады.

Позицияларды көшіру процедурасын қолдану шеңберінде сауда-клиринглік жүйеде мынадай тәртіптемелер пайдаланылады:

 - 1) ОК-мен "Өзін-өзі реттеу: ОК-мен авторепо 1 күн", "Өзін-өзі реттеу: ОК-мен авторепо 1 күн USD" сауда-саттық тәртіптемелері, оларда сауда-саттыққа қатысушылар Клиринг және есеп айырысу регламентінде анықталған уақыт ішінде сауда-саттыққа қатысушылардың кез келгенімен нарықтық шарттарда дефолттың басталу мүмкіндігін дербес реттей алады;
 - 2) ОК-мен "Реттеу: ОК-мен авторепо", "Реттеу: ОК-мен СВОП ФР" сауда-саттық тәртіптемелері, бұл ретте клиринглік ұйымы өз атынан Клиринглік ережелердің қор нарығының ерекшеліктеріне сәйкес айыппұл мөлшерлемелері және өзге де шарттар бойынша 1 күн мерзімімен репо/своп операцияларын жүзеге асыруға өтінімдер береді. Өтінімдер кез келген сауда-саттыққа қатысушының Клиринг және есеп айырысу регламентінде анықталған кезеңде оларды толық мөлшерде қанағаттандыру сәтіне дейін растауы үшін қолжетімді. Осы тәртіптемелердегі мәмілелер толық өтеу шарттарында жасалады;
 - 3) "ОК-мен автоматты реттеу: Тікелей РЕПО", "Реттеу: ОК-мен СВОП ФР" технологиялық тәртіптемелері, бұл ретте клиринглік ұйым сауда-саттыққа жосықсыз қатысушының немесе сауда-саттыққа адал қатысушының атынан өзімен бірге "тікелей" тәсілмен репо операцияларын немесе Клиринглік ережелердің қор нарығының ерекшеліктерінде анықталған тәртіппен айыппұл мөлшерлемелері және өзге де шарттар бойынша 1 күн мерзімімен своп операцияларын жүзеге асырады.
12. Позицияны мәжбүрлеп жою процедурасы Клиринглік ережелерге сәйкес сатып алу-сату мәмілелерін жасау және қажет болған жағдайда репо/своп операцияларын жасау арқылы жүзеге асырылады.

Позицияларды мәжбүрлеп жою процедурасын қолдану шеңберінде сауда-клиринглік жүйеде мынадай тәртіптемелер пайдаланылады:

 - 1) "ОК-мен автоматты реттеу: Тікелей К/П" технологиялық режимі, бұл ретте клиринглік ұйым сауда-саттыққа жосықсыз қатысушының немесе сауда-саттыққа адал

- қатысушының атынан клирингтік сессияларды өткізу кезеңінде Клирингтік ережелердің қор нарығының ерекшеліктерінде анықталған тәртіппен қандай да бір қаржы құралы бойынша оның ағымдағы есептік бағасы бойынша қазақстандық теңгемен тікелей сатып алу-сату мәмілелерін жасасады;
- 2) ОК-мен сатып алу-сату сауда-саттығының кез келген тәртіптемелері және қажет болған жағдайда клирингтік ұйымы биржалық сауда-саттық ішінде және/немесе қосымша сауда-саттық сессияларында және/немесе биржадан тыс нарықта өзінің танылған орындалмаған міндеттемелерін реттеу мақсатында өз атынан теңгерімдеуші мәмілелер жасайтын сатып алу-сату күнін жақындататын репо операцияларының кез келген тәртіптемелері. Теңгерімдеуші мәмілелерді жоғарыда көрсетілген тәсілдердің бірде-бірімен жасау мүмкін болмаған жағдайда клирингтік ұйым өз атынан сауда-саттыққа адал қатысушылармен олардың аттарынан әрекет ете отырып, ағымдағы есептік бағалар бойынша мәмілелер жасайды;
 - 3) тікелей мәмілелер әдісімен жасалатын сатып алу-сату мәмілелері бойынша ОК-мен сауда-саттық тәртіптемелері және қажет болған жағдайда, клирингтік ұйым биржалық сауда-саттық ішінде және/немесе қосымша сессияларда, және/немесе соңғы сауда-саттық сессиясы жабылғаннан кейін сауда-саттыққа дәрменсіз қатысушының атынан өздерінің танылған орындалмаған міндеттемелерін реттеу үшін осы тармақтың 2) тармақшасына сәйкес жасалған теңгерімдеуші мәмілелердің шарттарына сәйкес келетін шарттармен клирингтік ұйым алдындағы оның танылған орындалмаған міндеттемелерін реттеу мақсатында өзімен теңгерімдеуші мәмілелер жасасатын сатып алу-сату күнін жақындататын "тікелей" тәсілмен жүзеге асырылатын репо операцияларының тәртіптемелері;
 - 4) клирингтік ұйым биржалық сауда-саттық ішінде және/немесе қосымша сауда-саттық сессияларында және/немесе биржадан тыс нарықта сауда-саттыққа дәрменсіз қатысушының атынан нарықтық шарттарда жабу мәмілелерін жасайтын сауда-саттыққа дәрменсіз қатысушыны қамтамасыз етуді сатып алу-сатудың ОК-мен кез келген сауда-саттық тәртіптемелері.
13. Сауда-саттыққа жосықсыз/дәрменсіз қатысушы, сондай-ақ сауда-клирингтік шоттары реттеу процедуралары шеңберінде мәмілелерді жүзеге асыру үшін пайдаланылған сауда-саттыққа адал қатысушылар Клирингтік ережелерде және осы Тәртіпке сәйкес клирингтік ұйым өздерінің атынан жасалған барлық мәмілелер бойынша міндеттемелерді орындайды.
 14. Сауда-саттыққа жосықсыз/дәрменсіз қатысушы клирингтік ұйымның ішкі құжаттарына сәйкес позицияны ауыстыру және/немесе мәжбүрлеп жою процедурасын қолдану процедураларын қолданғаны үшін, сондай-ақ осы процедураларды жүргізу нәтижелері бойынша пайда болған орындалмаған нетто-міндеттемелер үшін тұрақсыздық айыбын төлейді.

6 тарау. ТҰЖЫРЫМДЫ ҚАҒИДАЛАР

9 бап. Келіспеушіліктер мен дауларды реттеу

Сауда-саттыққа қатысушылар арасында, сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушылар мен Биржа арасында мәмілелерді жасауға және орындауға байланысты туындайтын даулар мен жанжалдар Биржаның "Қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру процесінде туындайтын даулар мен жанжалдарды шешу тәртібі" атты ішкі құжатында белгіленген тәртіппен реттелуге жатады.

10 бап. Тұжырымды қағидалар

1. Осы Тәртіп және оған барлық өзгертулер және/немесе толықтырулар Биржаның интернет-ресурсында (www.kase.kz) орналастыру жолымен сауда-саттыққа қатысушылардың назарына жеткізіледі.
2. Осы Тәртіп қажеттілігіне қарай, бірақ осы Тәртіп қолданысқа енгізілген күннен бастап есептелетін әрбір үш жылда кемінде бір рет өзектендіруге жатады.

3. Осы Тәртіпке өзгертулер мен толықтырулардың уақтылы енгізілуі үшін сауда-саттық бөлімшесі жауапты болады.

Басқарма төрайымы

А. Ө. Алдамберген