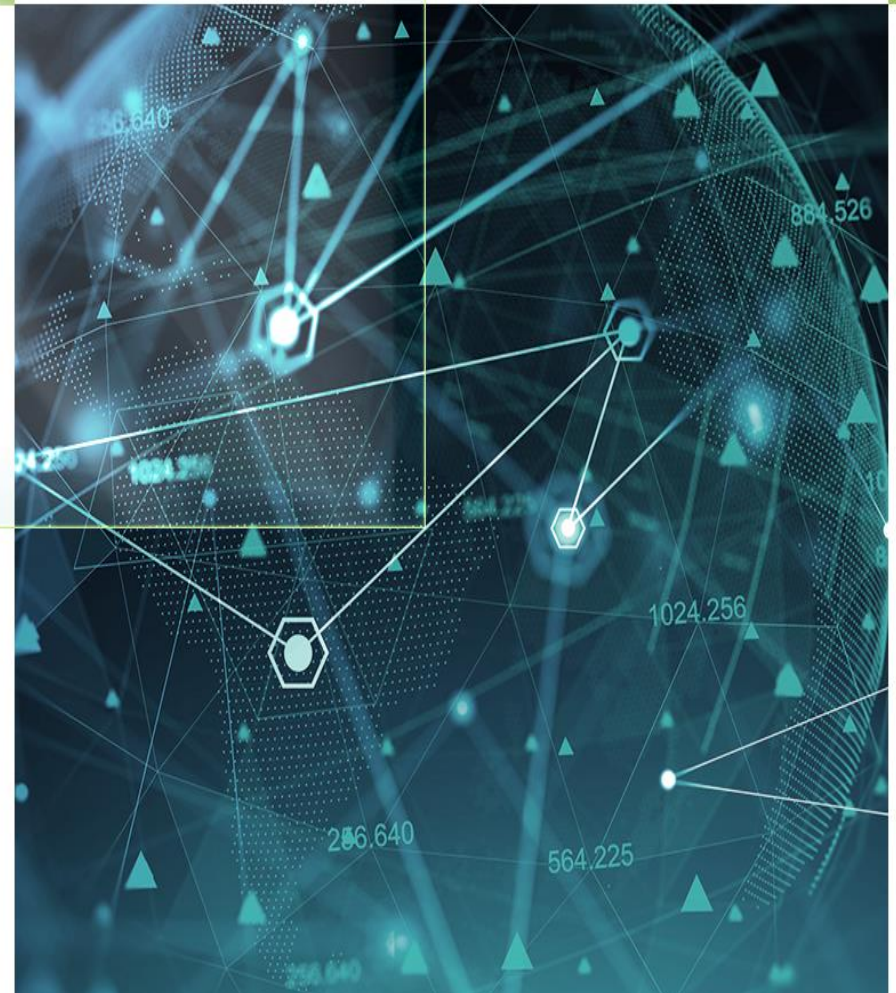


Услуги приема, учета и контроля
залогового обеспечения в
системе обеспечения
завершенности расчетов
в межбанковской системе
платежных карточек



Банку-участнику МСПК для участие в системе необходимо установить деловые отношения с Биржей.

Для этого Банку необходимо ознакомиться с внутренним документом Биржи - Правилами оказания услуг приема, учета и контроля залогового обеспечения в системе обеспечения завершенности расчетов в межбанковской системе платежных карточек. Правила размещены на сайте Бирже https://kase.kz/ru/kase_rules/. Вкладка Клиринг.

Банку необходимо присоединиться к Договору об оказании услуг приема, учета и контроля залогового обеспечения в системе обеспечения завершенности расчетов в межбанковской системе платежных карт. Для присоединения к Договору Банку необходимо заполнить, подписать и передать на Биржу Заявление о присоединении к договору (Приложение 2 к Правилам). Скан заявления передается по электронной почте на адрес clearing@kase.kz. Оригинал передается нарочно по адресу Биржи.

Договор заключается только с клиринговыми участниками. Если участник МСПК не является клиринговым участником Биржи, он должен заключить договор на обслуживание с клиринговым участником.

Банку-участнику МСПК необходимо открыть счет обеспечения в Центральном депозитарии.

В день открытия счета обеспечения в Центральном депозитарии Банк должен уведомить об этом Биржу.

Для уведомления Биржи Банку необходимо скачать, подписать и передать Бирже Уведомление об открытии счета обеспечения в АО "Центральный депозитарий ценных бумаг".

Уведомление размещено на сайте Биржи (Приложение 3 к Правилам).

Скан уведомления передается по электронной почте на адрес clearing@kase.kz. Оригинал передается нарочно по адресу Биржи.

Открытие счета обеспечения в торгово-клиринговой системе Биржи осуществляется на следующий рабочий день после открытия счета обеспечения в Центральном депозитарии.

После открытия счета обеспечения в торгово-клиринговой системе Биржи Банку необходимо перевести на счет обеспечения ГЦБ и/или деньги в тенге в сумме не менее суммы обеспечения, рассчитанной НБРК.

Перевод ГЦБ осуществляется путем подачи приказа на перевод в Центральный депозитарий.

Перевод осуществляется на раздел KASE счета обеспечения.

Биржа устанавливает внешнее ограничение на счет обеспечения в сумме равной сумме обеспечения, рассчитанной НБРК.

Банк не может списывать ГЦБ/деньги, если это приведет к снижению единого лимита ниже внешнего ограничения.

В случае необходимости замены одного вида ГЦБ другим необходимо сперва зачислить новые ГЦБ, затем списать старые.

В качестве обеспечения принимаются только ГЦБ, эмитированные в тенге и не являющиеся индексированными (код MUJ).

В случае возникновения у Банка задолженности по операциям в МСПК на основании полученного уведомления от НБРК Банк уведомляет Биржу по электронной почте clearing@kase.kz о необходимости снятия внешнего ограничения.

Далее Банк продает ГЦБ путем заключения прямой сделки в режиме торгов с ЦК на T0.

Полученную сумму от продажи ГЦБ Банк переводит в НБРК.

После завершения расчетов в МСПК Банк должен пополнить счет обеспечения ГЦБ и/или деньгами в тенге на сумму не менее суммы обеспечения, рассчитанной НБРК.

Этап 5: Использование обеспечения для покрытия задолженности в МСПК в случае невозможности продажи ГЦБ



В случае невозможности продажи ГЦБ для покрытия задолженности перед НБКР Банк уведомляет Биржу о необходимости перевода ГЦБ со счета обеспечения на счет НБРК.

Для уведомления Биржи Банку необходимо скачать, подписать и передать Бирже Распоряжение на перевод ценных бумаг.

Распоряжение размещено на сайте Биржи (Приложение 4 к Правилам).

Скан распоряжения передается по электронной почте на адрес clearing@kase.kz. Оригинал передается нарочно по адресу Биржи.

После завершения расчетов в МСПК Банк должен пополнить счет обеспечения ГЦБ и/или деньгами в тенге на сумму не менее суммы обеспечения, рассчитанной НБРК.

Биржа не определяет и не рассчитывает рыночные цены по ГЦБ.

Биржа осуществляет расчет цен по ГЦБ, затем полученную величину дисконтирует на ставки рыночных рисков. Полученное значение является риск-параметром по которому оценивается ГЦБ в едином лимите.

Списание ГЦБ со счета обеспечения Банка в пользу НБРК осуществляется по указанному выше риск-параметру. На эту сумму происходит уменьшение единого лимита. Эта сумма идет в зачет требований НБРК к Банку.

Спасибо за внимание!

Республика Казахстан, 050040
г. Алматы, ул. Байзакова, 280
Северная башня
Многофункционального комплекса
"Almaty Towers" 8-й этаж
Тел.: +7 (727) 237 5300
e-mail: info@kase.kz
www.kase.kz

FAQ

