

"KASE КЛИРИНГ ОРТАЛЫҒЫ" АҚ

"KASE Клиринг орталығы" АҚ
Басқармасының шешімімен
(отырыстың
2023 жылғы 01 шілдедегі № 17 хаттамасы)
бекітілген
2023 жылғы 21 шілдеден бастап¹
қолданысқа енгізілді

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессиялар өткізу **РЕГЛАМЕНТІ**

Алматы қ.
2023 жыл

¹ "KASE Клиринг орталығы" АҚ қызметі басталған күннен бастап

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. № 1 өзгерістер:

- "KASE Клиринг орталығы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілді (2024 жылдың 23 ақпанындағы № 12 отырыс хаттамасы);
- 2024 жылдың 01 наурызынан бастап қолданысқа енгізілді.

2. № 2 өзгерістер:

- "KASE Клиринг орталығы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілді (2024 жылдың 14 тамызындағы № 54 отырыс хаттамасы);
- 2024 жылдың 14 тамызынан бастап қолданысқа енгізілді.

3. № 3 өзгерістер мен толықтырулар:

- "KASE Клиринг орталығы" АҚ Басқармасының шешімімен бекітілді (2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі № 59 отырыс хаттамасы);
- 2024 жылдың 16 қыркүйегінен бастап қолданысқа енгізілді.

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті (бұдан әрі – Регламент) орталық контрагенттің функцияларын орындай отырып, "Қазақстан қор биржасы" АҚ өткізетін сауда-саттықтарда айналысқа жіберілген қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша "KASE Клиринг орталығы" АҚ (бұдан әрі - Клиринг орталығы) клирингілік қызметті жүзеге асыру тәртібін анықтайды. Орталық контрагент, сондай-ақ клиринг қатысушыларына ұсынылатын есептердің нысандары мен форматтарын сипаттайды.

1 бап. Жалпы қағидалар

1. Регламент Клиринг орталығы орталық контрагенттің функцияларын жүзеге асыратын операциялар бойынша биржалық нарықтардағы клирингілік қызмет шеңберінде Клиринг орталығы жүзеге асыратын рәсімдердің уақытын анықтайды.
2. Регламентте пайдаланылатын ұғымдар Қазақстан Республикасының заңнамасында көзделген, сондай-ақ Клиринг орталығының "қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асыру қағидалары" ішкі құжатында анықталған ұғымдармен бірдей.

2 бап. Клирингілік сессияларды өткізу уақыты

1. Клиринг орталығы клирингілік қызмет бойынша барлық қажетті рәсімдерді жүзеге асыратын клирингілік күн 08.00 ALT-де басталып, 23.59 ALT-де аяқталады.
2. Клиринг орталығының белгілі бір биржалық нарықтарда орталық контрагенттің функцияларын орындайтын мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асыру уақыты Регламентке 1-3 – қосымшаларында белгіленген.
3. Клирингілік сессияларды өткізу уақытын Клиринг орталығының Басқарма Төрағасының клирингілік бөлімшеге жетекшілік ететін орынбасары немесе оның міндетін атқарушы тұлға клирингілік сессияларды өткізу кезінде пайдаланылатын бағдарламалық-техникалық құралдардың жұмысында іркіліс болған, клирингілік сессияларды әдеттегідей өткізуге кедергі келтіретін мән-жайлар анықталған жағдайларда өзгерте алады.
4. Қандай да бір кезеңде клирингілік сессияларды өткізуде кідіріс туындаған жағдайда, келесі кезеңнің басталу уақыты туындаған кідіріс уақытынан аспайтын уақытқа ауысады.

3 бап. Клирингілік қатысушыларға ұсынылатын клирингілік есептерді қалыптастыру тәртібі

1. Кез келген биржалық нарықтың клирингілік есептері клирингілік жүйеде қалыптастырылады және клирингілік қатысушыларға электрондық құжаттармен алмасу жүйесі арқылы жіберіледі eTransfer.kz ². Бұл ретте:
 - 1) Қор нарығының клирингілік есептері XML форматында (8, 9 қосымшалар), XLS форматында (6-1 қосымша), XLS және XML форматында (4, 5, 6, 7, 10 қосымшалар және PDF форматында (11 қосымша) қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады (*осы тармақша Клирингілік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі шешімімен өзгертілді*);

² Клиринг орталығы мен клирингілік қатысушы арасындағы кепілдендірілген жеткізіліммен және берілетін деректердің құпиялылығы мен түзетілмейтіндігін қамтамасыз ететін криптографиялық қорғау құралдарымен электрондық құжат айналымының мамандандырылған жүйесі.

- 2) Валюта нарығының клирингтік есептері XLS (15-1 қосымша), XLS және XML (12, 13, 14, 15, 16, 17 қосымшалар) форматтарында қалыптастырылған электрондық құжаттар болып табылады және PDF (18 қосымша) *(осы тармақша Клирингтік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі шешімімен өзгертілді)*.
- 3) Туынды құралдар нарығының клирингтік есептері XLS, XML (19, 20 қосымшалар) және PDF (21 қосымша) форматында құрылған электрондық құжаттар болып табылады.
2. Кез-келген биржалық нарықтың XLS, XML, PDF форматындағы әрбір клирингтік есебінде мәтін жолдары түріндегі тақырып және деректері бар жолдар болып табылатын мазмұн бөлігі бар.
3. Кез келген биржалық нарықтың XML форматындағы әрбір клирингтік есебін келесіге түрлендіруге болады:
 - алушыға ыңғайлы кез-келген формат (соның ішінде бөлгіштері бар TXT форматы) өзінің бэк-офис бағдарламалық жасақтамасымен және/немесе стандартты бағдарламалық жасақтамамен (MS Excel) өңдеу арқылы;
 - Microsoft Internet Explorer-де файлды ашу арқылы баспа түрінде.

4-бап. Қорытынды ережелер

1. Регламентке өзгерістер мен толықтырулардың уақтылы енгізілуіне клирингтік бөлімше жауапты болады.
2. Регламент қажеттілігіне қарай, бірақ кемінде үш жылда бір рет өзектендіруге жатады.

Басқарма Төрағасы

Сабитов И. М.

**Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу
регламенті**

Орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингтік
сессияларды өткізу
Регламентіне

1 қосымша

*(Осы қосымша Клирингтік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі
шешімімен өзгертілген)*

**Қор нарығындағы есеп айырысу-клирингтік сессиялар
РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	09:00 – 10:30	Mark-to-market клирингтік сессиясы
2.		Маржа талаптарын анықтау
3.		Репо мәмілелері және Үн сатып алу/сату мәмілелері бойынша купондар мен дивидендтер бойынша төлемдерді қайтару ³
4.		Клирингтік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат – табыс беру жөніндегі міндеттемелер / табыс алу жөніндегі талаптар туралы ақпарат – мүлктік пулдарға енгізілген мүлік туралы ақпарат. – стресске қарсы қамтамасыз ету туралы ақпарат (аптаның бірінші жұмыс күнінде анықталған, стресске қарсы қамтамасыз ету мөлшері).
5.	14:00	– Клирингтік қатысушылардың mark-to-market клирингтік сессиясын өткізу кезінде анықталған маржалық талаптарды жабуының соңғы уақыты; – Стресске қарсы қамтамасыз етуді жеткізудің соңғы уақыты (анықталған аптадан кейінгі келесі аптаның бірінші жұмыс күнінде анықталған, стресске қарсы қамтамасыз ету мөлшері).
6.	15:30 – 17:30	Бірінші есеп айырысу-клирингтік сессия
7.		ALT 15:30-ға дейін жасалған орындалу күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
8.		Клирингтік қатысушыларға ALT 15:30-ға дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
9.		Клирингтік қатысушылардың қаржы құралдарын (ақшаны – Орталық депозитарийдегі Клиринг орталығының корреспонденттік шотына,

³ Ішінара қамтамасыз етілген мәмілелер және мәміле жасалған күннен өзгеше есеп айырысу күні бойынша.

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
	16:00	бағалы қағаздарды – KASE бөліміне) орындаудың басталған күні ALT 15:30-ға дейін жасалған, өзін-өзі реттеу режимдерінде жасалған мәмілелерді ескере отырып, ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді орындау үшін жеткізудің соңғы уақыты 16:00 ALT
10.		ALT 16:00-ге дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың орындалмаған нетто-міндеттемелерін реттеу
11.		ALT 16:35-ке дейін жасалған толық қамтылған мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
12.		Бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
12		Нетто-операцияларды тіркеуге бұйрық бойынша есеп айырысудан бас тартылған жағдайда қосымша жүргізіледі: Нетто–операцияларды тіркеуге арналған бұйрықты есептеуден бас тартуға байланысты қатысушылардың нетто-міндеттемелерінің дефолтын реттеу; Нетто міндеттемелер дефолтын реттеу мәмілелерін ескере отырып, бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
13		Клирингтік қатысушыларға бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша қорытынды нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
14	17:30 – 19:15	Екінші есеп айырысу-клирингтік сессия
15		ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған орындалу күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша қорытынды нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
16		Клирингтік қатысушыларға ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған орындау күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
17	17:45	Клирингтік қатысушылардың қаржы құралдарын (ақшаны – Орталық депозитарийдегі Клиринг орталығының корреспонденттік шотына, бағалы қағаздарды – KASE бөліміне) орындалған мәмілелерді ескере отырып, ALT 15:30-дан 17:30-ға дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді орындау үшін жеткізудің соңғы уақыты 17:45 ALT дейін өзін-өзі реттеу режимдерінде
18		ALT 17:45-ке дейін жасалған, орындалған күні басталған ішінара қамтамасыз етумен мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың орындалмаған нетто-міндеттемелерін реттеу
19		Екінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу
20		Нетто-операцияларды тіркеуге бұйрықты есептеуден бас тартқан жағдайда қосымша жүргізіледі: Нетто–операцияларды тіркеуге арналған бұйрықты есептеуден бас тартуға байланысты қатысушылардың нетто-міндеттемелерінің

**Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу
регламенті**

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
А	1	2
		дефолтын реттеу; Нетто міндеттемелер дефолтын реттеу мәмілелерін ескере отырып, бірінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша есеп айырысуларды жүргізу.
21		Клирингтік қатысушыларға есептер беру: – екінші есеп айырысу клирингтік сессиясының мәмілелері бойынша қорытынды нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы; – болашақ есеп айырысу күндерімен мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы; – клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы.

Орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингілік
сессияларды өткізу
Регламентіне

2 қосымша

*(Осы қосымша Клирингілік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі
шешімімен өзгертілген)*

Валюта нарығындағы есеп айырысу-клирингілік сессиялар

РЕГЛАМЕНТІ

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	09:00-09:30	Mark-to-market клирингілік сессиясы
2.		Орындаудың басталмаған күндерімен мәмілелер бойынша маржалық талаптарды анықтау
3.		Вариациялық маржаны алу жөніндегі міндеттемелерді / талаптарды анықтау
4.		Клирингілік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – margin-call туралы ақпарат; – Вариациялық маржаны алу жөніндегі міндеттемелер / талаптар туралы ақпарат; – стресске қарсы қамтамасыз ету туралы ақпарат (аптаның бірінші жұмыс күнінде анықталған, стресске қарсы қамтамасыз ету мөлшері).
5.	11:30 – 12:00	CNY есептеулеріне арналған таңертеңгі клирингілік сессия
6.		Қытайлық юаньдағы нетто талаптарды / нетто міндеттемелерді орындау мерзімі аяқталған мәмілелер бойынша анықтау
7.		Орындалатын күні бар мәмілелер бойынша қытай юанімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
8.		Клирингілік қатысушыларға Қытай юаніндегі нетто талаптар / нетто міндеттемелер туралы есептерді орындау күні басталған мәмілелер бойынша ұсыну
9.	12:15	Клиринг орталығына қытайлық юань клирингілік қатысушыларының орындалатын күні бар мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеу үшін жеткізудің соңғы уақыты
10.	12:30-12:45	Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша клирингілік сессия
11.		ALT 12:15-тен 12:30-ға дейін жасалған Қытай юаньдері бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
12.		Қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
13.		Клирингілік қатысушыларға қытай юані бойынша өтімділік провайдерлерімен мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
		міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
14.	14:00	– Клирингілік қатысушылардың mark-to-market клирингілік сессиясын өткізу кезінде клирингілік маржалық талаптарды жабуының соңғы уақыты; – Стресске қарсы қамтамасыз етуді жеткізудің соңғы уақыты (аптаның бірінші жұмыс күнінде, стресске қарсы қамтамасыз ету мөлшері анықталған аптадан кейін).
15.	15:30 – 16:00	T0 бойынша есептеулерге арналған негізгі клирингілік сессия
16.		Орындалу күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгедегі, АҚШ долларындағы, еуроғағы, ресей рубліндегі нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау
17.		Орындалу күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгемен, АҚШ долларымен, еуромен, ресей рублімен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүргізу
18.		Клирингілік қатысушыларға орындалған күні бар мәмілелер бойынша қазақстандық теңгедегі, АҚШ долларындағы, еуроғағы, ресей рубліндегі нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну
19.	17:00	Клиринг орталығына клирингілік қатысушылардың қазақстандық теңгені, АҚШ долларын, еуроны, ресей рублін орындалатын күні бар мәмілелер бойынша нетто-міндеттемелерді төлеуге жеткізудің соңғы уақыты
20.	17:30 – 18:00	Қосымша клирингілік сессия
21.		Жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптарды / нетто-міндеттемелерді анықтау: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
22.		Жасалған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгеде, АҚШ долларында, еуроға, ресей рублінде есеп айырысулар жүргізу: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
23.		Клирингілік қатысушыларға жасалған мәмілелер бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы есептерді ұсыну: - қосымша сауда сессиясында; - еуро бойынша өтімділік провайдерлерімен, ALT 17:00-ден 17:30-ға дейін жасалған ресей рублімен
24.	19:00-19:30	Жосықсыз клирингілік қатысушылармен клирингілік сессия
25.		Клирингілік қатысушылардың орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін орындау күні басталған мәмілелер бойынша қазақстандық теңгемен, АҚШ долларымен, еуромен, ресей рублімен, қытай юанімен реттеу
26.		Орындалмаған позицияларды келесі жұмыс күніне ауыстыру мәмілелерін жасасу

Орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингтік
сессияларды өткізу
Регламентіне

3 қосымша

(Бұл қосымша Клиринг орталығы басқармасының 2024 жылғы 14 тамыздағы шешімімен өзгертілді)

**Туынды құралдар нарығындағы клирингтік сессия
РЕГЛАМЕНТІ**

№ р/с	Операция уақыты, (ALT)	Операцияның атауы
A	1	2
1.	13:00	Вариациялық маржа бойынша қорытынды нетто-міндеттемелерді орындау үшін клирингтік қатысушылардың ақша жеткізуінің соңғы уақыты
2.	13:00 – 17:30	Margin-call бойынша клирингтік қатысушылардың орындалмаған қорытынды нетто-міндеттемелерін реттеу
3.	17:30 – 18:00	Аралық клирингтік сессия
4.		Әрбір есеп айырысу коды / агрегатталған сауда-клирингтік шот / сегрегатталған сауда-клирингтік шот бойынша жасалған мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың аралық нетто-талаптарын / нетто-міндеттемелерін анықтау
5.		Кепілдік қамтамасыз етуді есептеу
6.		Сауда лимитін есептеу
7.	21:30 – 22:00	Соңғы клирингтік сессия
8.		Әрбір есеп айырысу коды / агрегатталған сауда-клирингтік шот / сегрегатталған сауда-клирингтік шот бойынша жасалған мәмілелер бойынша клирингтік қатысушылардың қорытынды нетто-талаптарын / нетто-міндеттемелерін анықтау
9.		Кепілдік қамтамасыз етуді есептеу
10.		Сауда лимитін есептеу
11.		Margin-call бекіту
12.	23:59-ға дейін	Клирингтік қатысушыларға осыны қамтитын есептерді ұсыну: – сауда-клирингтік шоттарда ескерілетін позициялар туралы; – Вариациялық маржаны алу бойынша төлемдер / талаптар бойынша қорытынды міндеттемелер туралы; – margin-call туралы ақпарат

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

4 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

АЛДЫН АЛА ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNT_Ses1_PRE *		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингілік сессиясының реттік нөмірі		integer		
		"1" – 15:30-дағы клирингілік сессия				
		"2" – 17:30-да клирингілік сессия				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингілік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	POSITION_TYPE	Егер "C" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" – бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	DEBIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_PRE *						
/KASE_DOC						

* *TNT_Ses1_PRE – бірінші есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау;*
TNT_Ses2_PRE – екінші есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін алдын ала есепті кодтау.

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

5 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

Қ О Р Ы Т Ы Н Д Ы Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNT_Ses1_FIN *		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-міндеттемелер / нетто-талаптар туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингілік сессиясының реттік нөмірі		integer		
		"1" – 15:30-дағы клирингілік сессия				
		"2" – 17:30-да клирингілік сессия				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
POSTYPES		Клирингілік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "C" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" – бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	DEBIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_FIN *						
/KASE_DOC						

* *TNT_Ses1_FIN* – бірінші есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау;
TNT_Ses2_FIN – екінші есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін қорытынды есепті кодтау.

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу Регламентіне

6 қосымша

Margin-call туралы

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
MRC		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Клирингілік қатысушының негізгі ақшалай позициясының коды	+	string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Margin-call сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

/FIRM						
/MRC						
/KASE_DOC						

** Екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттарға байланыстыру үшін қолданылады.*

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

6-1 қосымша

(Осы қосымша Клирингілік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі шешімімен толықтырылған)

Стресске қарсы қамтамасыз ету туралы

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрі	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		Түбір элементі (түбір элементі) XML құжаты				
CLS		Есеп деректері блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда-саттық коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Клирингілік қатысушының негізгі ақшалай позициясының коды	+	string	12	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

COLLATERAL						
	STRESS_COLLATERAL	Стресске қарсын қамтамасыз ету сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/COLLATERAL						
/SETTLE						
/FIRM						
/CLS						
/KASE_DOC						

* Екінші деңгейдегі сауда-клирингілік шоттарға байланыстыру үшін қолданылады.

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

7 қосымша

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

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
TNF		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
POSTYPES		Ақша позициясы бойынша немесе депозитарлық бөлім бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" –бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string		
GROUP		Клирингілік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шоты	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	10	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз		string	12	
	DEBIT_NETTO_Y0	Нетто міндеттеме / міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_NETTO_Y0	Нетто талап	+	decimal	20	2
	SETTLEDATE	Орындалу күні	+	date		
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/POSTYPES						
/FIRM						
/TNF						
/KASE_DOC						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу Регламентіне

8 қосымша

Табыс беру жөніндегі міндеттемелер / табыс алу жөніндегі талаптар туралы

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
RFN		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Бас фирманың атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының ақшалай позициясының коды	+	string	12	
	POSITION_TYPE	Егер "С" болса, онда салынған түйіндерде ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады. Егер "S" –бағалы қағаздар бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпарат болады	+	string		
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы		string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	30	
RECORDS		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	Сауда-саттық жүйесіндегі мәміле нөмірі *	+	string	20	0
	OPERATION_NO	Сауда жүйесіндегі кірісті есептеу операциясының нөмірі	+	string	20	
	TRADE_DATE	Мәміле жасалған күн	+	date		
	SETTLEDATE1	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 1-бөлігінің орындалу күні	+	date		
	SETTLEDATE2	РЕПО мәмілесінің / сатып алу-сату мәмілесінің 2-бөлігінің орындалу күні	+	date		
	RECORD_DATE	Табыс алуға құқығы бар адамдардың тізімін жасау күні	+	date		
	DEBIT/CREDIT	Табысты беру жөніндегі міндеттеменің бағыты (міндеттеме (D) / талап (C))	+	string		
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
	QUANTITY	Мәміле көлемі, бағалы қағаздарда	+	decimal	20	0
	PRICE	Табыс	+	decimal	38	16
	REFUND_SUM	Кірісті беру бойынша міндеттеме / талап сомасы	+	decimal	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/FIRM						
/RFN						
/KASE_DOC						

* "TradeNo" жолағында бет мәмілесінің нөмірі көрсетіледі.

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

9 қосымша

Таза негізде клирингке кірген мәмілелер бойынша

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
CNT		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Бас фирманың идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық режимі бойынша деректер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық режимінің идентификаторы	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық режимінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Есеп айырысу валютасы бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	
RECORDS		Мәміле бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	ASTS+ сауда-клирингілік жүйесіндегі мәміле нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		
	BUY_SELL	Мәміле / мәміле бөлігі (сатып алу (B) / сату (S))	+	string	1	
	SETTLECODE	Мәміле бойынша есеп айырысу коды	+	string	6	
	TRADE_TYPE	Мәміле түрі	+	string	1	
	PRICE	Бір бағалы қағаздың бағасы	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Бағалы қағаздардағы / шетел валютасындағы мәміле көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Ақшадағы мәміле көлемі	+	decimal	20	2
SETTLE		Есептеулер бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Нақты есеп айырысу күні	+	date		
	SETTLETIME	Есеп айырысу уақыты	+	time		
	SESSION_NO	Клирингілік сессияның нөмірі	+	integer	1	
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/BOARD						
/FIRM						
/CNT						
/KASE_DOC						

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

10 қосымша

Мүліктік пулдарға енгізілген мүлік туралы

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
GCG		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Бас фирманың идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының шоттары бойынша ақпарат блогы				
	BANK_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
	DEP_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының депо шотының коды	+	string		
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Бағалы қағаздар бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Бағалы қағаздың идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Бағалы қағаздың толық атауы		string	0-120	
	ISIN	ISIN бағалы қағаз	+	string	20	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
RECORDS		ЖК-ге енгізілген мүлік бойынша ақпарат блогы				
	QUANTITY	Депозит шотындағы бағалы қағаздардың саны	+	decimal	20	0
	BALANCE	Есеп айырысу коды бойынша ақша қаражатының көлемі	+	decimal	20	2
	DOC_DATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/GCG						
/KASE_DOC						

Орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингілік
сессияларды өткізу
Регламентіне

11 қосымша

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

Клирингілік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы есеп

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингілік қатысушының атауы: _____

Клирингілік қатысушының сауда 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 дейінгі кепілдік жарнаның мөлшері	
Клирингілік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін кепілдік жарнадан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Дәрменсіз клирингілік қатысушылардың міндеттемелерін жабу үшін кепілдік жарнадан Клиринг орталығы пайдаланған сома	
Сауда-саттық қорытындылары бойынша кепілдік жарнаның мөлшері	
Кепілдік жарнаны қалпына келтіру бойынша міндеттемелер	

Клирингілік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингілік резервтік қор бойынша клирингілік қатысушының міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингілік резервтік қордың мөлшері	

**Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу
регламенті**

Клирингілік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингілік резервтік қордан Клиринг орталығы 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 мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

12 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшем і	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNTall*		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
	SESSION_NO	Нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы алдын ала есеп қалыптастырылған есеп айырысу клирингілік сессиясының реттік нөмірі	+	integer		
		2 – CNY есептеулеріне арналған клирингілік сессия				
		3 – CNY бойынша өтімділік провайдерлерімен есеп айырысуға арналған клирингілік сессия				
		4 – T0 бойынша есептеулерге арналған негізгі клирингілік сессия				
		5 – қосымша клирингілік сессия				
		6 – жосықсыз клирингілік қатысушылармен клирингілік сессия				
FIRM		Фирманың деректер блогы				

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
GROUP		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
CURRENCY						
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	2
SETTLE						
	DEBIT	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT	Ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO	Нетто-талап / ішінара қамтамасыз ету мәмілелері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT						
/KASE_DOC						

* *TNT_ – есеп айырысу клирингтік сессиясы үшін есепті кодтау.*

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу Регламентіне

13 қосымша

Клирингілік қатысушының нетто-талаптары / нетто-міндеттемелері туралы

Қ О Р Ы Т Ы Н Д Ы Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNTFINfx		Есеп деректерінің блогы				
	TODAYDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	date time		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
SETTLE		Мәмілелер бойынша есеп айырысу міндеттемелері / талаптары бойынша ақпарат блогы				
	NETTO_FOREX	Нетто-талап / сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	NETTO_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_VARMARGIN	Нетто-талап / вариациялық маржа бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Қорытынды нетто-талап немесе нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNTFINfx						
/KASE_DOC						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу Регламентіне

14 қосымша

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

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
TNFx*		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы	+	string	0-120	
GROUP		Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоты бойынша ақпарат блогы				
	TRADEDATE	Есеп айырысу күні	+	datetime		
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шотының коды	+	string	12	
POSTYPES		Клирингілік қатысушының позициялары бойынша ақпарат блогы				
	POSITION_TYPE	Егер "CASH" болса, онда салынған түйіндер ақша позициясы бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпаратты қамтиды. Егер "SECURITY" болса, түйіндер қаржы құралдары	+	string	12	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
		бойынша нетто-талаптар / нетто-міндеттемелер туралы ақпаратты қамтиды				
CURRENCY		Валюта бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Есеп айырысу валютасының атауы		string	0-120	
SECURITY		Қаржы құралдары бойынша ақпарат блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының идентификаторы	+	string	12	
SETTLE		Міндеттемелер бойынша ақпарат блогы/				
	CREDIT_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша мәмілелер бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_BUYSELL	Сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша мәмілелер бойынша талап	+	decimal	20	2
	NETTO_BUYSELL	Нетто-талап / сатып алу-сату / жеткізу фьючерстері бойынша нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	CREDIT_DEF	Реттеу мәмілелері бойынша міндеттеме	+	decimal	20	2
	DEBIT_DEF	Реттеу мәмілелері бойынша талап	+	decimal	20	2

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	NETTO_DEF	Есеп айырысу мәмілелері бойынша нетто-талап / нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Қорытынды нетто-талап немесе нетто-міндеттеме	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNFfx						
/KASE_DOC						

* *TNFfx – есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін болашақ нетто есепті кодтау.*

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

15-1 қосымша

(Осы қосымша Клирингілік орталық Басқармасының 2024 жылдың 11 қыркүйегіндегі шешімімен толықтырылды)

Стреске қарсы қамтамасыз ету туралы

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрі	Көлемі	Ондық таңбалар
KASE_DOC		Түбір элементі (түбір элементі) XML құжаты				
CLSfx		Есеп деректері блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	dateTime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда-саттық коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
COLLATERAL						
	STRESS_COLLATERAL	Стреске қарсы қамтамасыз ету сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/COLLATERAL						
/SETTLE						
/FIRM						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттамасы	Міндеттілігі	Түрі	Көлемі	Ондық таңбалар
/CLSfx						
/KASE_DOC						

Орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

15 қосымша

Margin-call туралы
ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
MRCfx		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Маржалық талап сомасы, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
/MRCfx						
/KASE_DOC						

* MRC fx – margin-call есебін кодтау.

орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

16 қосымша

Клирингке кірген мәмілелер бойынша

Е С Е П

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты.				
CNTfx		Есеп деректерінің блогы				
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Бас фирманың идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Клирингілік қатысушының сауда коды	+	string	12	
BOARD		Сауда-саттық режимі бойынша деректер блогы				
	BOARD_ID	Сауда-саттық режимінің идентификаторы	+	string	4	
	BOARD_NAME	Сауда-саттық режимінің атауы	+	string	30	
CURRENCY		Есеп айырысу валютасы бойынша ақпарат блогы				
	CURRENCY_ID	Есеп айырысу валютасының идентификаторы	+	string	4	
SECURITY		Қаржы құралы бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
RECORDS		Мәміле бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_NO	ASTS+ сауда-клирингілік жүйесіндегі мәміле нөмірі	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Сауда-саттық күні	+	date		
	BUY_SELL	Мәміле / мәміле бөлігі (сатып алу (B) / сату (S))	+	string	1	
	PRICE	Мәміле курсы. Шетел валютасымен операциялар / своп операциялары үшін ашылу немесе жабылу мәмілесінің бағасы.	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Қаржы құралдары санындағы мәміле көлемі	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Мәміле көлемі ақшамен, есеп айырысу валютасымен	+	decimal	20	2
SETTLE		Есептеулер бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Нақты есеп айырысу күні	+	date		
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNTfx						
KASE_DOC						

* CNTfx – таза негізде клиринге енгізілген мәмілелер бойынша есепті кодтау.

орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингтік
сессияларды өткізу Регламентіне

17 қосымша

Вариациялық маржаны төлеу жөніндегі міндеттемелер / талаптар туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
VMR		Есеп деректерінің блогы				
	TRADEDATE	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	FIRM	Фирма идентификаторы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Фирманың толық атауы		string	120	
SETTLE		Сауда коды бойынша ақпарат блогы				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Сауда-саттыққа қатысушының сауда-саттық коды		string	12	
SECURITY		Қаржы құралы бойынша деректер блогы				
	SECURITY_ID	Қаржы құралының идентификаторы	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Қаржы құралының толық атауы		string	0-120	
SETTLEDATE		Орындалу күні бойынша ақпарат блогы				
	SETTLEDATE	Орындалу күні	+	datetime		

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
RECORDS		Валюта нарығының туынды қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша міндеттемелер / талаптар бойынша ақпарат блогы				
	PREVIOUS_SETTLE_PRICE	Алдыңғы есеп айырысу бағасы (алдыңғы сауда күнінен бұрын жасалған мәмілелер үшін) / мәміле бағасы (алдыңғы сауда күнінде жасалған мәмілелер үшін)		number	20	6
	PREVIOUS_QUANTITY	Алдыңғы сауда күніндегі базалық активтің саны		number	20	2
	PREVIOUS_TRADE_VOLUME	Алдыңғы сауда күніндегі мәміле көлемі		number	20	2
	CURRENT_SETTLE_PRICE	Мәміленің ағымдағы есеп айырысу бағасы		number	20	6
	CURRENT_QUANTITY	Ағымдағы сауда күніндегі базалық активтің саны		number	20	2
	CURRENT_TRADE_VOLUME	Ағымдағы сауда күніндегі мәміле көлемі		number	20	2
	VARIATION_MARGIN	Вариациялық маржаны төлеу бойынша міндеттеме / талап (белгісімен көрсетіледі)		number	20	2
/RECORDS						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/SETTLE						
/FIRM						
/VMR						
/KASE_DOC						

* VMR – Вариациялық маржаны төлеу бойынша міндеттемелер/ талаптар туралы есепті кодтау.

орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингтік
сессияларды өткізу
Регламентіне

18 қосымша

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы

ЕСЕП

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингтік қатысушының атауы: _____

Клирингтік қатысушының сауда коды: _____

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

Клирингтік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қор бойынша міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингтік резервтік қордан Клиринг орталығы пайдаланған сома	

**Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу
регламенті**

Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс

орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

19 қосымша

Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоттарының позициялық жай-күйі туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
FUTPOS*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	account	Клирингілік қатысушының сауда коды	+	string	120	
ISIN						
	isin	Құралдың таңбалық коды	+	string	10	
SETTLE						
	pos_beg	Күннің басындағы позиция	+	decimal	20	2
	pos_end	Күннің соңындағы позиция	+	decimal	20	2
FEE						
	fee	Клиент / фирма және құрал үшін жиынтық алым				
	fee_ex	Биржалық алым		decimal	20	2
	fee_cc	Клирингілік алым		decimal	20	2
VM						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	vm	Вариациялық маржа				
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/ISIN						
/FIRM						
/FUTPOS*						
/KASE_DOC						

* *FUTPOS_ – есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін есепті кодтау.*

орталық контрагентпен жасалатын
мәмілелер бойынша клирингілік
сессияларды өткізу Регламентіне

20 қосымша

Клирингілік қатысушының сауда-клирингілік шоттарының ақшалай жағдайы туралы

ЕСЕП

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
KASE_DOC		Түбір элементі (root element) XML құжаты				
FUTMON*		Есеп деректерінің блогы				
	date	Есеп қалыптастырылатын күн	+	datetime		
FIRM		Фирманың деректер блогы				
	account	Клирингілік қатысушының сауда коды	+	string	120	
SETTLE						
	amount_beg	Күннің басына ақша	+	decimal	20	2
	pay	Шот бойынша қозғалыс	+	decimal	20	2
	amount_end	Күннің соңына дейінгі ақша				
FEE						
	go	Фьючерстер бойынша жиынтық МО				
	fee_fut	Фьючерстік биржалық алым		decimal	20	2
VM						

Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингілік сессияларды өткізу регламенті

Ноданың атауы	Атрибут атауы	Сипаттама	Міндеттеме	Түрі	Өлшемі	Ондық бөлшектер
	vm	Вариациялық маржа				
LIMIT						
	free					
/LIMIT						
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/FIRM						
/FUTMON*						
/KASE_DO C						

* *FUTMON_ – есеп айырысу клирингілік сессиясы үшін есепті кодтау.*

орталық контрагентпен
жасалатын мәмілелер
бойынша клирингтік
сессияларды өткізу
Регламентіне

21 қосымша

Клирингтік қорлар бойынша талаптар мен міндеттемелер туралы

ЕСЕП

Есеп беру күні: _____

№ _____

Клирингтік қатысушының атауы: _____

Клирингтік қатысушының сауда коды: _____

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

Клирингтік қатысушының кепілдік жарнаны қажетті мөлшерге дейін қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі

Клирингтік резервтік қор бойынша клирингтік қатысушының міндеттемелерін есептеу	Сомасы, теңге
Сауда-саттық басталғанға дейінгі клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік қатысушының (меншікті немесе клиенттік) міндеттемелерін жабу үшін клирингтік резервтік қордан Клиринг орталығы пайдаланған сома	

**Орталық контрагентпен жасалатын мәмілелер бойынша клирингтік сессияларды өткізу
регламенті**

Сауда-саттық қорытындылары бойынша клирингтік резервтік қордың мөлшері	
Клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемелер	

Клирингтік қатысушының клирингтік резервтік қорды қалпына келтіру жөніндегі міндеттемесі мыналарға дейінгі мерзімде орындалуы тиіс
