

# АО "КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР KASE"

---

---

**У т в е р ж д е н**

решением Правления  
АО "Клиринговый центр KASE"

(протокол заседания  
от 01 июля 2023 года № 17)

**Введен в действие**

с 21 июля 2023 года<sup>1</sup>

## РЕГЛАМЕНТ

проведения клиринговых сессий  
по сделкам с центральным контрагентом

---

---

г. Алматы

2023 год

---

<sup>1</sup> С даты начала деятельности АО "Клиринговый центр KASE"

## ЛИСТ ПОПРАВК

### 1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Клиринговый центр KASE" (протокол заседания от 23 февраля 2024 года № 12);
- введены в действие с 01 марта 2024 года.

### 2. Изменения № 2:

- утверждены решением Правления АО "Клиринговый центр KASE" (протокол заседания от 14 августа 2024 года № 54);
- введены в действие с 14 августа 2024 года.

### 3. Изменения и дополнения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Клиринговый центр KASE" (протокол заседания от 11 сентября 2024 года № 59);
- введены в действие с 16 сентября 2024 года.

### 4. Изменение № 4:

- утверждено решением Правления АО "Клиринговый центр KASE" (протокол заседания от 24 января 2025 года № 5);
- введены в действие с 24 января 2025 года.

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом (далее – Регламент) определяет порядок осуществления АО "Клиринговый центр KASE" (далее – Клиринговый центр) клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами, допущенными к обращению на проводимых АО "Казахстанская фондовая биржа" торгах, исполняя функции центрального контрагента, а также описывают формы и форматы отчетов, предоставляемых клиринговым участникам.

### Статья 1. Общие положения

1. Регламент определяет время проведения процедур, проводимых Клиринговым центром в рамках осуществления клиринговой деятельности на биржевых рынках по сделкам, по которым Клиринговый центр исполняет функции центрального контрагента.
2. Понятия, используемые в Регламенте предусмотрены законодательством Республики Казахстан, а также идентичны понятиям, которые определены внутренним документом Клирингового центра "Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами".

### Статья 2. Время проведения клиринговых сессий

1. Клиринговый день, в течение которого Клиринговый центр осуществляются все необходимые процедуры по клиринговой деятельности, начинается в 08.00 ALT и заканчивается в 23.59 ALT.
2. Время осуществления Клиринговым центром клиринговой деятельности по сделкам, с которыми Клиринговый центр исполняет функции центрального контрагента на определенных биржевых рынках установлено приложениями 1 – 3 к Регламенту.
3. Время проведения клиринговых сессий может быть изменено заместителем Председателя Правления Клирингового центра, курирующим клиринговое подразделение или лицом, исполняющим его обязанности, в случаях сбоя в работе программно-технических средств, которые используются при проведении клиринговых сессий, выявления обстоятельств, препятствующих проведению клиринговых сессий в обычном режиме, или иных обстоятельств.
4. В случае возникновения задержки в проведении клиринговых сессий на каком-либо этапе, время начала следующего этапа сдвигается на время, не превышающее времени возникшей задержки.

### Статья 3. Порядок формирования клиринговых отчетов, предоставляемых клиринговым участникам

1. Клиринговые отчеты любого биржевого рынка формируются в клиринговой системе и направляются клиринговым участникам посредством системы обмена электронными документами eTransfer.kz<sup>2</sup>. При этом:
  - 1) Клиринговые отчеты фондового рынка являются электронными документами, сформированными в формате XML (приложения 8, 9), в формате XLS (приложение 6-1), в формате XLS и XML (приложения 4, 5, 6, 7, 10) и в формате PDF (приложение 11) *(данный подпункт изменен решением Правления Клирингового центра от 11 сентября 2024 года);*
  - 2) Клиринговые отчеты валютного рынка являются электронными документами, сформированными в формате XLS (приложение 15-1), в формате XLS и XML (приложения 12, 13, 14, 15, 16, 17) и PDF (приложение 18) *(данный подпункт изменен решением Правления Клирингового центра от 11 сентября 2024 года);*

---

<sup>2</sup> Специализированная система электронного документооборота между Клиринговым центром и клиринговым участником с гарантированной доставкой и криптографическими средствами защиты, обеспечивающая конфиденциальность и некорректируемость передаваемых данных.

- 3) Клиринговые отчеты рынка деривативов являются электронными документами, сформированными в формате XLS, XML (приложения 19, 20) и PDF (приложение 21).
2. Каждый клиринговый отчет любого биржевого рынка в формате XLS, XML, PDF содержит заголовок в виде текстовых строк и содержательную часть, представляющую собой строки с данными.
3. Каждый клиринговый отчет любого биржевого рынка в формате XML может быть преобразован в:
  - любой удобный получателю формат (в том числе, формат TXT с разделителями) путем обработки собственными программными средствами бэк-офиса и/или стандартными программными средствами (MS Excel);
  - в печатную форму путем открытия файла в Microsoft Internet Explorer.

#### **Статья 4. Заключительные положения**

1. Ответственность за своевременное внесение изменений и дополнений в Регламент несет клиринговое подразделение.
2. Регламент подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

Председатель Правления

Сабитов И.М.

**Приложение 1**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

*(Данное приложение изменено решением Правления Клирингового центра от 24 января 2025 года)*

**РЕГЛАМЕНТ  
расчетно-клиринговых сессий на фондовом рынке**

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
A	1	2
1.	<b>09:00 – 10:30</b>	<b>Клиринговая сессия mark-to-market</b>
2.		Определение маржинальных требований
3.		Возврат выплат по купонам и дивидендам по сделкам репо и сделкам купли/продажи $Yn^3$
4.		Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: – информацию о margin-call; – информацию об обязательствах по передаче / требованиях по получению дохода; – информацию об имуществе, внесенном в имущественные пулы; – информация об обеспечении под стресс (в первый рабочий день недели, в который определен размер обеспечения под стресс).
5.	<b>14:00</b>	– Окончательное время закрытия клиринговыми участниками маржинальных требований, определенных при проведении клиринговой сессии mark-to-market; – Окончательное время поставки обеспечения под стресс (в первый рабочий день недели, следующий за неделей, когда определен размер обеспечения под стресс); – Окончательное время закрытия обязательств по доведению обеспечения по сделкам с финансовыми инструментами на биржевом рынке принимающей биржи.
6.	<b>15:30 – 17:30</b>	<b>Первая расчетно-клиринговая сессия</b>
7.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT
8.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT
9.	<b>15:30</b>	Окончательное время поставки клиринговыми участниками удаленного доступа денег – на корреспондентский счет Клирингового

<sup>3</sup> По сделкам с частичным обеспечением и датой расчетов отличной от даты заключения сделки.

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
		центра в Центральном депозитарии для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с финансовыми инструментами на биржевых рынках принимающей биржи, заключенным в предыдущий рабочий день.
10.	16:00	Окончательное время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет Клирингового центра в Центральном депозитарии, ценных бумаг – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 16:00 ALT
11.		Урегулирование неисполненных нетто-обязательств клиринговых участников по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 16:00 ALT
12.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с полным покрытием, заключенным до 16:35 ALT
13.		Проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии
14.		<b>В случае отказа расчетов по приказу на регистрацию нетто-операций дополнительно производится:</b> урегулирование дефолта нетто-обязательств участников в связи с отказом в расчетах приказа на регистрацию нетто-операций; проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии с учетом сделок урегулирования дефолта нетто-обязательств
15.		Предоставление клиринговым участникам отчетов об итоговых нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам первой расчетной клиринговой сессии
16.	17:30 – 19:15	<b>Вторая расчетно-клиринговая сессия</b>
17.		Определение итоговых нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT
18.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT
19.	17:45	Окончательное время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет Клирингового центра в Центральном депозитарии, ценных бумаг – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 17:45 ALT
20.		Урегулирование неисполненных нетто-обязательств клиринговых участников по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 17:45 ALT
21.		Проведение расчетов по сделкам второй расчетной клиринговой

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
		сессии
22.		<p><b>В случае отказа расчетов приказа на регистрацию нетто-операций дополнительно производится:</b></p> <p>урегулирование дефолта нетто-обязательств участников в связи с отказом в расчетах приказа на регистрацию нетто-операций;</p> <p>проведение расчетов по сделкам первой расчетной клиринговой сессии с учетом сделок урегулирования дефолта нетто-обязательств.</p>
23.		<p>Предоставление клиринговым участникам отчетов:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– об итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях по сделкам второй расчетной клиринговой сессии;</li> <li>– о нетто-обязательствах / нетто-требованиях по сделкам с будущими датами расчетов;</li> <li>– о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам.</li> </ul>

**Приложение 2**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

*(Данное приложение изменено решением Правления Клирингового центра от 11 сентября 2024 года)*

**РЕГЛАМЕНТ  
расчетно-клиринговых сессий на валютном рынке**

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
1.	<b>09:00-09:30</b>	<b>Клиринговая сессия mark-to-market</b>
2.		Определение маржинальных требований по сделкам с наступившими датами исполнения
3.		Определение обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи
4.		Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: – информацию о margin-call; – информацию об обязательствах по уплате / требований по получению вариационной маржи; – информация об обеспечении под стресс (в первый рабочий день недели, в который определен размер обеспечения под стресс).
5.	<b>11:30 – 12:00</b>	<b>Утренняя клиринговая сессия для расчетов по CNY</b>
6.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
7.		Проведение расчетов по сделкам в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
8.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах в китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
9.	<b>12:15</b>	Крайнее время поставки Клиринговому центру клиринговыми участниками китайских юаней в оплату нетто-обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения
10.	<b>12:30-12:45</b>	<b>Клиринговая сессия по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням</b>
11.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням, заключенным с 12:15 до 12:30 ALT
12.		Проведение расчетов по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням
13.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам с провайдерами ликвидности по китайским юаням



№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
14.	<b>14:00</b>	– Окончательное время закрытия клиринговыми участниками маржинальных требований, определенных при проведении клиринговой сессии mark-to-market; – Окончательное время поставки обеспечения под стресс (в первый рабочий день недели, следующий за неделей, когда определен размер обеспечения под стресс).
15.	<b>15:30 – 16:00</b>	<b>Основная клиринговая сессия для расчетов по Т0</b>
16.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
17.		Проведение расчетов по сделкам в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
18.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам с наступившей датой исполнения
19.	<b>17:00</b>	Крайнее время поставки Клиринговому центру клиринговыми участниками казахстанских тенге, долларов США, евро, российских рублей в оплату нетто-обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения
20.	<b>17:30 – 18:00</b>	<b>Дополнительная клиринговая сессия</b>
21.		Определение нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
22.		Проведение расчетов в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
23.		Предоставление клиринговым участникам отчетов о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по сделкам, заключенным: – на дополнительной торговой сессии; – с провайдерами ликвидности по евро, российским рублям, заключенным с 17:00 до 17:30 ALT
24.	<b>19:00-19:30</b>	<b>Клиринговая сессия с недобросовестными клиринговыми участниками</b>
25.		Урегулирование неисполненных итоговых нетто-обязательств клиринговых участников в казахстанских тенге, долларах США, евро, российских рублях, китайских юанях по сделкам с наступившей датой исполнения
26.		Заключение сделок переноса неисполненных позиций на следующий

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

---

---

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
		рабочий день

**Приложение 3**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

*(Данное приложение изменено решением Правления Клирингового центра от 14 августа 2024 года)*

**РЕГЛАМЕНТ**  
**клиринговой сессии на рынке деривативов**

№ п/п	Время проведения операции, (ALT)	Наименование операции
А	1	2
1.	13:00	Крайнее время поставки клиринговыми участниками денег для исполнения итоговых нетто-обязательств по вариационной марже
2.	13:00 – 17:30	Урегулирование неисполненных итоговых нетто-обязательств клиринговых участников по margin-call
3.	17:30 – 18:00	<b>Промежуточная клиринговая сессия</b>
4.		Определение промежуточных нетто-требований / нетто-обязательств клиринговых участников по заключенным сделкам по каждому расчетному коду / агрегированному торгово-клиринговому счету / сегрегированному торгово-клиринговому счету
5.		Расчет гарантийного обеспечения
6.		Расчет торгового лимита
7.	21:30 – 22:00	<b>Финальная клиринговая сессия</b>
8.		Определение итоговых нетто-требований / нетто-обязательств клиринговых участников по заключенным сделкам по каждому расчетному коду / агрегированному торгово-клиринговому счету / сегрегированному торгово-клиринговому счету
9.		Расчет гарантийного обеспечения
10.		Расчет торгового лимита
11.		Фиксация margin-call
12.	до 23:59	Предоставление клиринговым участникам отчетов, содержащих: – о позициях, учитываемых на торгово-клиринговых счетах; – об итоговых обязательствах по уплате / требований по получению вариационной маржи; – информацию о margin-call

#### Приложение 4

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

### ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫЙ ОТЧЕТ о нетто-требованиях / нетто-обязательствах клирингового участника

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNT_Ses1_PRE *		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
	SESSION_NO	Порядковый номер расчетной клиринговой сессии, для которой сформирован предварительный отчет о нетто-требованиях / нетто-обязательствах "1" – клиринговая сессия в 15:30 "2" – клиринговая сессия в 17:30		integer		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценным бумагам				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				
	DEBIT_Y0	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_PRE *						
/KASE_DOC						

\* *TNT\_Ses1\_PRE – кодировка предварительного отчета для первой расчетной клиринговой сессии;*  
*TNT\_Ses2\_PRE – кодировка предварительного отчета для второй расчетной клиринговой сессии.*

**Приложение 5**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ИТОГОВЫЙ ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто-обязательствах клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNT_Ses1_FIN *		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
	SESSION_NO	Порядковый номер расчетной клиринговой сессии, для которой сформирован предварительный отчет о нетто-обязательствах / нетто-требованиях		integer		
		"1" – клиринговая сессия в 15:30				
		"2" – клиринговая сессия в 17:30				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценным бумагам				
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				
	DEBIT_Y0	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	CREDIT_Y0	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO_Y0	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT_Ses1_FIN *						
/KASE_DOC						

\* TNT\_Ses1\_FIN – кодировка итогового отчета для первой расчетной клиринговой сессии;

TNT\_Ses2\_FIN – кодировка итогового отчета для второй расчетной клиринговой сессии.

**Приложение 6**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ  
о margin-call**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
MRC		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Код основной денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Сумма margin-call, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						



Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

---

---

/MRC						
/KASE_DOC						

\* *Используется для привязки к торгово-клиринговым счетам второго уровня.*

**Приложение 6-1**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

*(Данное приложение дополнено решением Правления Клирингового центра от 11 сентября 2024 года)*

**ОТЧЕТ**  
**об обеспечении под стресс**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
CLS		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника		string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	CLEARING_BANK_ACCOUNT_ID*	Код основной денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
COLLATERAL						
	STRESS_COLLATERAL	Сумма обеспечения под стресс, тг.	+	decimal	20	2

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

---

---

/COLLATERAL						
/SETTLE						
/FIRM						
/CLS						
/KASE_DOC						

\* *Используется для привязки к торгово-клиринговым счетам второго уровня.*

**Приложение 7**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах по сделкам с наступившей датой расчетов**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
TNF		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
POSTYPES		Блок информации по денежной позиции или по депозитарному разделу				
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string		
GROUP		Блок данных по счетам клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	DEPOSITORY_ACCOUNT_ID	Счет депо клирингового участника	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов		string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	30	

**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	10	
	ISIN	ISIN ценной бумаги		string	12	
	DEBIT_NETTO_Y0	Нетто-обязательство / обязательство	+	decimal	20	2
	CREDIT_NETTO_Y0	Нетто-требование / требование	+	decimal	20	2
	SETTLEDATE	Дата исполнения	+	date		
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/POSTYPES						
/FIRM						
/TNF						
/KASE_DOC						

**Приложение 8**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**об обязательствах по передаче / требованиях по получению дохода**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
RFN		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Наименование головной фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по счетам клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
	BANK_ACCOUNT_ID	Код денежной позиции клирингового участника	+	string	12	
	POSITION_TYPE	Если "С" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "S" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по ценным бумагам	+	string		
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов		string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	30	
RECORDS		Блок данных по обязательствам				
	TRADE_NO	Номер сделки в Системе торгов *	+	string	20	0
	OPERATION_NO	Номер операции по начислению дохода в торговой системе	+	string	20	
	TRADE_DATE	Дата заключения сделки	+	date		

**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	SETTLEDATE1	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО / сделки купли-продажи	+	date		
	SETTLEDATE2	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО / сделки купли-продажи	+	date		
	RECORD_DATE	Дата составления списка лиц, имеющих право на получение дохода	+	date		
	DEBIT/CREDIT	Направленность обязательства по передаче дохода (Обязательство (D) / Требование (C))	+	string		
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
	QUANTITY	Объем сделки, в ценных бумагах	+	decimal	20	0
	PRICE	Доход	+	decimal	38	16
	REFUND_SUM	Сумма обязательства / требования по передаче дохода	+	decimal	20	2
/RECORDS						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/RFN						
/KASE_DOC						

\* В поле "TradeNo" указывается номер лицевой сделки.

**Приложение 9**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**по сделкам, вошедшим в клиринг на нетто основе**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
CNT		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор головной фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Клирингового участника	+	string	12	
BOARD		Блок данных по режиму торгов				
	BOARD_ID	Идентификатор режима торгов	+	string	4	
	BOARD_NAME	Наименование режима торгов	+	string	30	
CURRENCY		Блок данных по валюте расчетов				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценной бумаге				
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TRADE_NO	Номер сделки в торгово-клиринговой системе ASTS+	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Дата торгов	+	date		



Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	BUY_SELL	Направленность сделки / части сделки (покупка (B) / продажа (S))	+	string	1	
	SETTLECODE	Код расчетов по сделке	+	string	6	
	TRADE_TYPE	Тип сделки	+	string	1	
	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Объем сделки в ценных бумагах / иностранной валюте	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Объем сделки в деньгах	+	decimal	20	2
SETTLE		Блок информации по расчетам				
	SETTLEDATE	Фактическая дата расчетов	+	date		
	SETTLETIME	Время расчетов	+	time		
	SESSION_NO	Номер клиринговой сессии	+	integer	1	
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNT						
/KASE_DOC						

**Приложение 10**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**об имуществе, внесенном в имущественные пулы**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
GCG		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор головной фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	0-120	
GROUP		Блок информации по счетам клирингового участника				
	BANK_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета Клирингового участника	+	string	12	
	DEP_ACCOUNT_ID	Код счета депо Клирингового участника	+	string		
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по ценной бумаге				
	SECURITY_ID	Идентификатор ценной бумаги	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование ценной бумаги		string	0-120	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	+	string	20	
RECORDS		Блок данных по имуществу внесенному в ИП				
	QUANTITY	Количество ценных бумаг на счете	+	decimal	20	0

**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

<b>Название ноды</b>	<b>Название атрибута</b>	<b>Описание</b>	<b>Обязательность</b>	<b>Тип</b>	<b>Размер</b>	<b>Десятичные знаки</b>
		депо				
	BALANCE	Объем денежных средств по расчетному коду	+	decimal	20	2
	DOC_DATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/GCG						
/KASE_DOC						

## О Т Ч Е Т

### о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам

#### Отчет о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам

Дата отчета: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Наименование клирингового участника: \_\_\_\_\_

Торговый код клирингового участника: \_\_\_\_\_

Расчет требований и обязательств клирингового участника по клиринговому гарантийному фонду	Сумма, тенге
Необходимый размер гарантийного вноса:	
для клирингового участника, являющегося банком	
для клирингового участника, не являющегося банком	
Размер гарантийного вноса до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного вноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного вноса для покрытия обязательств несостоятельных клиринговых участников	
Размер гарантийного вноса по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению гарантийного вноса	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению гарантийного вноса до необходимого размера должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_

Расчет обязательств клирингового участника по клиринговому резервному фонду	Сумма, тенге
Размер клирингового резервного фонда до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из клирингового резервного фонда для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Размер клирингового резервного фонда по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению клирингового резервного фонда	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению клирингового резервного фонда должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_

**Приложение 12**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ****о нетто-требованиях / нетто обязательствах клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNTall*		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
	SESSION_NO	Порядковый номер расчетной клиринговой сессии, для которой сформирован предварительный отчет о нетто-требованиях / нетто-обязательствах	+	integer		
		2 – клиринговая сессия для расчетов по CNY				
		3 – клиринговая сессия для расчетов с Провайдерами ликвидности по CNY				
		4 – основная клиринговая сессия для расчетов по T0				
		5 – дополнительная клиринговая сессия				
		6 – клиринговая сессия с недобросовестными клиринговыми участниками				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
GROUP		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Участника торгов		string	12	
CURRENCY						
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	2
SETTLE						
	DEBIT	Обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2

**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	CREDIT	Требование по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
	NETTO	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам с частичным обеспечением	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNT						
/KASE_DOC						

\* *TNT\_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.*

**Приложение 13**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ИТОГОВЫЙ ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNTFINfx		Блок данных отчета				
	TODAYDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	datetime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
SETTLE		Блок данных по расчетным обязательствам / требованиям по сделкам				
	NETTO_FOREX	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Нетто-требование / нетто-обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	NETTO_VARMARGIN	Нетто-требование / нетто-обязательство по вариационной марже	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Итоговое нетто-требование или нетто-обязательство	+	decimal	20	2

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
/SETTLE						
/CURRENCY						
/GROUP						
/FIRM						
/TNTFINfx						
/KASE_DOC						



**Приложение 14**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**о нетто-требованиях / нетто обязательствах по сделкам с наступившей датой расчетов**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
TNfx*		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы	+	string	0-120	
GROUP		Блок информации по торгово-клиринговому счету клирингового участника				
	TRADEDATE	Дата расчетов	+	datetime		
	TRADE_ACCOUNT_ID	Код торгово-клирингового счета клирингового участника	+	string	12	
POSTYPES		Блок информации по позициям Клирингового участника				
	POSITION_TYPE	Если "CASH" – то во вложенных нодах содержится информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по денежной позиции, если "SECURITY" – информация о нетто-требованиях / нетто-обязательствах по финансовым инструментам	+	string	12	
CURRENCY		Блок данных по валюте				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
	CURRENCY_NAME	Наименование валюты расчетов		string	0-120	
SECURITY		Блок данных по финансовым инструментам				

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
SETTLE		Блок данных по обязательствам/				
	CREDIT_SWAP	Обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	DEBIT_SWAP	Требование по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	NETTO_SWAP	Нетто-требование / нетто-обязательство по операциям с иностранной валютой / операциям своп	+	decimal	20	2
	CREDIT_BUYSELL	Обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	DEBIT_BUYSELL	Требование по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	NETTO_BUYSELL	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам купли-продажи / поставочного фьючерса	+	decimal	20	2
	CREDIT_DEF	Обязательство по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	DEBIT_DEF	Требование по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	NETTO_DEF	Нетто-требование / нетто-обязательство по сделкам урегулирования	+	decimal	20	2
	NETTO_TOTAL	Итоговое нетто-требование или нетто-обязательство	+	decimal	20	2
/SETTLE						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/POSTYPES						
/GROUP						
/FIRM						
/TNFfx						
/KASE_DOC						

\* TNFfx – кодировка отчета о будущих нетто для расчетной клиринговой сессии.

**Приложение 15**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ  
о margin-call**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
MRCfx		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Участника торгов		string	12	
MARGIN						
	MARGINCALL	Сумма Маржинального требования, тг.	+	decimal	20	2
/MARGIN						
/SETTLE						
/FIRM						
/MRCfx						
/KASE_DOC						

\*MRCfx – кодировка отчета о margin-call.

**Приложение 15-1**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

*(Данное приложение дополнено решением Правления Клирингового центра от 11 сентября 2024 года)*

**ОТЧЕТ**  
**об обеспечении под стресс**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
CLSfx		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Участника торгов		string	12	
COLLATERAL						
	STRESS_COLLATERAL	Сумма обеспечения под стресс, тг.	+	decimal	20	2
/COLLATERAL						
/SETTLE						
/FIRM						

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
/CLSfx						
/KASE_DOC						

**Приложение 16**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**по сделкам, вошедшим в клиринг**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.				
CNTfx		Блок данных отчета				
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор головной фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	0-120	
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Клирингового участника	+	string	12	
BOARD		Блок данных по режиму торгов				
	BOARD_ID	Идентификатор режима торгов	+	string	4	
	BOARD_NAME	Наименование режима торгов	+	string	30	
CURRENCY		Блок данных по валюте расчетов				
	CURRENCY_ID	Идентификатор валюты расчетов	+	string	4	
SECURITY		Блок данных по финансовому инструменту				
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование финансового инструмента		string	0-120	
RECORDS		Блок данных по сделке				
	TRADE_NO	Номер сделки в торгово-клиринговой системе ASTS+	+	decimal	20	0
	TRADEDATE	Дата торгов	+	date		
	BUY_SELL	Направленность сделки / части сделки (покупка (B) / продажа (S))	+	string	1	

**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	PRICE	Курс сделки. Для операций с иностранной валютой / операций своп цена сделки открытия или сделки закрытия.	+	decimal	20	6
	QUANTITY	Объем сделки в количестве финансовых инструментов	+	decimal	20	0
	AMOUNT	Объем сделки в деньгах, в валюте расчетов	+	decimal	20	2
SETTLE		Блок информации по расчетам				
	SETTLEDATE	Фактическая дата расчетов	+	date		
/SETTLE						
/RECORDS						
/SECURITY						
/CURRENCY						
/BOARD						
/FIRM						
/CNTfx						
KASE_DOC						

\* CNTfx – кодировка отчета по сделкам, вошедшим в клиринг на нетто основе.

**Приложение 17**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**об обязательствах/ требованиях по уплате вариационной маржи**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
VMR		Блок данных отчета				
	TRADEDATE	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	FIRM	Идентификатор фирмы	+	string	0-12	
	FIRM_NAME	Полное наименование фирмы		string	120	
SETTLE		Блок информации по торговому коду				
	TRADE_ACCOUNT_ID	Торговый код Участника торгов		string	12	
SECURITY		Блок данных по финансовому инструменту				
	SECURITY_ID	Идентификатор финансового инструмента	+	string	12	
	SECURITY_NAME	Полное наименование финансового инструмента		string	0-120	
SETTLEDATE		Блок данных по Дате исполнения				
	SETTLEDATE	Дата исполнения	+	dateTime		
RECORDS		Блок данных по обязательствам / требованиям по сделкам с производными финансовыми инструментами валютного рынка				
	PREVIOUS_SETTLE_PRICE	Предыдущая расчетная цена (для сделок, заключенных раньше предыдущего торгового дня) / Цена сделки (для сделок, заключенных в предыдущий торговый день)		number	20	6
	PREVIOUS_QUANTITY	Количество базового актива в предыдущий торговый день		number	20	2



**Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
	PREVIOUS_TRADE_VOLUME	Объем сделки в предыдущий торговый день		number	20	2
	CURRENT_SETTLE_PRICE	Текущая расчетная цена сделки		number	20	6
	CURRENT_QUANTITY	Количество базового актива в текущий торговый день		number	20	2
	CURRENT_TRADE_VOLUME	Объем сделки в текущий торговый день		number	20	2
	VARIATION_MARGIN	Обязательство/ Требование по уплате вариационной маржи (указывается со знаком)		number	20	2
/RECORDS						
/SETTLEDATE						
/SECURITY						
/SETTLE						
/FIRM						
/VMR						
/KASE_DOC						

\* VMR – кодировка отчета об обязательствах/ требованиях по уплате вариационной маржи.

**Приложение 18**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам**

Дата отчета: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Наименование клирингового участника: \_\_\_\_\_

Торговый код клирингового участника: \_\_\_\_\_

<b>Расчет требований и обязательств клирингового участника по клиринговому гарантийному фонду</b>	<b>Сумма, тенге</b>
Необходимый размер гарантийного вноса	
Размер гарантийного вноса до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного вноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного вноса для покрытия обязательств несостоятельных клиринговых участников	
Размер гарантийного вноса по итогам торгов	
Обязательства/ требования по гарантийному взносу: '+' – обязательства '-' – требования	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению гарантийного вноса до необходимого размера должно быть исполнено в срок до \_\_\_\_\_**

<b>Расчет обязательств клирингового участника по клиринговому резервному фонду</b>	<b>Сумма, тенге</b>
Размер клирингового резервного фонда до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из клирингового резервного фонда для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Размер клирингового резервного фонда по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению клирингового резервного фонда	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению клирингового резервного фонда должно быть исполнено в срок до \_\_\_\_\_**

**Приложение 19**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ****о позиционном состоянии торгово-клиринговых счетов клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
FUTPOS*		Блок данных отчета				
	date	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	account	Торговый код клирингового участника	+	string	120	
ISIN						
	isin	Символьный код инструмента	+	string	10	
SETTLE						
	pos_beg	Позиция на начало дня	+	decimal	20	2
	pos_end	Позиция на конец дня	+	decimal	20	2
FEE						
	fee	Суммарный сбор для клиента/фирмы и инструмента				
	fee_ex	Биржевой сбор		decimal	20	2
	fee_cc	Клиринговый сбор		decimal	20	2
VM						
	vm	Вариационная маржа				
/VM						
/FEE						

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
/SETTLE						
/ISIN						
/FIRM						
/FUTPOS*						
/KASE_DOC						

\* *FUTPOS\_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.*

**Приложение 20**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**о денежном состоянии торгово-клиринговых счетов клирингового участника**

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
KASE_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа				
FUTMON*		Блок данных отчета				
	date	Дата, за которую формируется отчет	+	dateTime		
FIRM		Блок данных фирмы				
	account	Торговый код клирингового участника	+	string	120	
SETTLE						
	amount_beg	Денег на начало дня	+	decimal	20	2
	pay	Движение по счету	+	decimal	20	2
	amount_end	Денег на конец дня				
FEE						
	go	Суммарное ГО по фьючерсам				
	fee_fut	Фьючерсный биржевой сбор		decimal	20	2
VM						
	vm	Вариационная маржа				

Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

Название ноды	Название атрибута	Описание	Обязательность	Тип	Размер	Десятичные знаки
LIMIT						
	free					
/LIMIT						
/VM						
/FEE						
/SETTLE						
/FIRM						
/FUTMON*						
/KASE_DOC						

\* *FUTMON\_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.*

**Приложение 21**

к Регламенту проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом

**ОТЧЕТ**

**о требованиях и обязательствах по клиринговым фондам**

Дата отчета: \_\_\_\_\_

№ \_\_\_\_\_

Наименование клирингового участника: \_\_\_\_\_

Торговый код клирингового участника: \_\_\_\_\_

<b>Расчет требований и обязательств клирингового участника по клиринговому гарантийному фонду</b>	<b>Сумма, тенге</b>
Необходимый размер гарантийного взноса	
Размер гарантийного взноса до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного взноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Сумма, использованная Клиринговым центром из гарантийного взноса для покрытия обязательств несостоятельных клиринговых участников	
Размер гарантийного взноса по итогам торгов	
Обязательства/ требования по гарантийному взносу: '+' – обязательства '-' – требования	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению гарантийного взноса до необходимого размера должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_

<b>Расчет обязательств клирингового участника по клиринговому резервному фонду</b>	<b>Сумма, тенге</b>
Размер клирингового резервного фонда до начала торгов	
Сумма, использованная Клиринговым центром из клирингового резервного фонда для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника	
Размер клирингового резервного фонда по итогам торгов	
Обязательства по восстановлению клирингового резервного фонда	

**Обязательство клирингового участника по восстановлению клирингового резервного фонда должно быть исполнено в срок до** \_\_\_\_\_