

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н ы

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 02 июля 2021 года № 66)

Введены в действие

с 07 июля 2021 года

ФОРМАТЫ

клиринговых отчетов на рынке деривативов

г. Алматы

2021

Настоящие Форматы разработаны в соответствии с внутренними документами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), регулирующими осуществление клиринговой деятельности, и описывают формы и форматы отчетов, предоставляемых клиринговым участникам.

1. В настоящих Форматах используются понятия и термины, определенные законодательством Республики Казахстан и внутренними документами Биржи.
2. Клиринговые отчеты рынка деривативов формируются в клиринговой системе в порядке, установленном внутренним документом Биржи "Регламент проведения клиринговых сессий по сделкам с центральным контрагентом" и направляются клиринговым участникам посредством системы обмена электронными документами eTransfer.kz¹.
3. Клиринговые отчеты рынка деривативов являются электронными документами, сформированными в формате XLS, XML (приложения 1, 2) и PDF (приложение 3).
4. Каждый клиринговый отчет рынка деривативов в формате XLS, XML содержит заголовок в виде текстовых строк и содержательную часть, представляющую собой строки с данными.
5. Каждый клиринговый отчет рынка деривативов 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.

¹ Специализированная система электронного документооборота между Биржей и клиринговым участником с гарантированной доставкой и криптографическими средствами защиты, обеспечивающая конфиденциальность и некорректируемость передаваемых данных.

Приложение 1

к Форматам клиринговых отчетов
на рынке деривативов

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 | | | | | | |

Форматы клиринговых отчетов на рынке деривативов

| Название ноды | Название атрибута | Описание | Обязательность | Тип | Размер | Десятичные знаки |
|---------------|-------------------|--------------------|----------------|-----|--------|------------------|
| | vm | Вариационная маржа | | | | |
| /VM | | | | | | |
| /FEE | | | | | | |
| /SETTLE | | | | | | |
| /ISIN | | | | | | |
| /FIRM | | | | | | |
| /FUTPOS* | | | | | | |
| /KASE_DOC | | | | | | |

* *FUTPOS_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.*

Приложение 2

к Форматам клиринговых отчетов
на рынке деривативов

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 | | | | | | |

Форматы клиринговых отчетов на рынке деривативов

| Название ноды | Название атрибута | Описание | Обязательность | Тип | Размер | Десятичные знаки |
|---------------|-------------------|--------------------|----------------|-----|--------|------------------|
| | vm | Вариационная маржа | | | | |
| LIMIT | | | | | | |
| | free | | | | | |
| /LIMIT | | | | | | |
| /VM | | | | | | |
| /FEE | | | | | | |
| /SETTLE | | | | | | |
| /FIRM | | | | | | |
| /FUTMON* | | | | | | |
| /KASE_DOC | | | | | | |

* *FUTMON_ – кодировка отчета для расчетной клиринговой сессии.*

Приложение 3

к Форматам
клиринговых отчетов
на рынке деривативов

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 взноса | |
| Размер гарантийного взноса до начала торгов | |
| Сумма, использованная Биржей из гарантийного взноса для покрытия (собственных или клиентских) обязательств клирингового участника | |
| Сумма, использованная Биржей 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 _____

| Расчет обязательств клирингового участника по клиринговому резервному фонду | Сумма, тенге |
|---|--------------|
| Размер клирингового резервного фонда до начала торгов | |
| Сумма, использованная Биржей 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 _____