

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Директорлар кеңесінің шешімімен
(2020 жылдың 03 маусымындағы
№ 18 отырыс хаттамасы)
б е к і т і л д і

2020 жылдың 03 тамызынан бастап
қолданысқа енгізілді

Орталық контрагенттің қатысуынсыз
бағалы қағаздармен мәмілелер жасасу және
олар бойынша есеп айырысуды жүзеге
асыру

ТӘРТІБІ

(гросс-есеп айырысу)

*(Осы тақырыптама Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі
шешімімен өзгертілген)*

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. № 1 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен (2023 жылдың 26 шілдесіндегі № 18 отырыс хаттамасы) бекітілген;
- 2023 жылдың 25 қыркүйегінен бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Тәртіп Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес әзірленді, "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) өткізетін сауда-саттықта орталық контрагенттің қатысуынсыз бағалы қағаздармен мәмілелер жасасу тәртібін анықтайды, осындай мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүзеге асыруға қойылатын негізгі талаптарды, сондай-ақ осы мәмілелердің орындалмағаны үшін жауапкершілікті және сауда-саттыққа қатысушылар өз міндеттемелерін орындамаған жағдайда айыппұлдар төлеу тәртібін белгілейді ([осы преамбула Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген](#)).

1 бап. Негізгі ұғымдар мен терминдер

1. Осы Тәртіптің мақсаттары үшін:

- 1) өтінім деп сауда-саттыққа қандай да бір қатысушы берген (осы ұғым Биржаның "Биржалық қызметті жүзеге асыру ережелері" атты ішкі құжатымен анықталғандай) сауда-саттықтың қандай да бір тәртіптемесінде мәміле жасасуға арналған өтінім түсініледі;
- 2) мәміле деп репо операциясын ашу немесе жабу мәмілесі, сондай-ақ ОК-сыз сауда-саттық тәртіптемесінде қаржы құралдарын орналастыру, сатып алу, сатып алу, сату бойынша жазылу, жария ұсыныс не мамандандырылған сауда-саттық әдісімен Биржа өткізетін сауда-саттық шеңберінде жасалған мәміле түсініледі ([осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген](#));
- 2) жайғасымның шектелімі деп, соның шегінде жайғасым ашылуы мүмкін ақшадағы немесе бағалы қағаздардағы мән түсініледі;
- 3) кінәлі сауда-саттыққа қатысушы деп сауда-саттыққа осындай қатысушы жасасқан мәміле бойынша өз міндеттемелерін орындамаған сауда-саттыққа қатысушы түсініледі;
- 4) зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушы деп сауда-саттыққа кінәлі қатысушының осы мәміле бойынша өз міндеттемелерін орындамауы себебінен жасалған мәміле орындалмаған сауда-саттыққа қатысушы түсініледі;
- 5) жайғасым деп Биржаның сауда-клирингтік жүйесіндегі сауда-саттыққа қатысушысының (және/немесе оның клиенттерінің) сауда-клирингтік шоттарында ескерілетін ақша сомасы (ақша бойынша жайғасымы) немесе бағалы қағаздардың саны (бағалы қағаздар бойынша жайғасымы) түсініледі;
- 6) "Z0" есеп айырысу коды деп олар бойынша міндеттемелер гросс-негізде орындалуға жататын, мәмілелер жасасу кезінде пайдаланылатын, өтінім берген кезде осы мәмілелер жасалған күн есеп айырысуларды жүзеге асыру күні болып табылатын, туындайтын міндеттемелердің толық қамтамасыз етілуін бақылау процедурасы жүргізілетінін анықтайтын есеп айырысу коды түсініледі;
- 7) "Zcp" есеп айырысу коды деп міндеттемелері гросс-негізде орындалуға жататын мәмілелер жасасу кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі, ол орындауға есеп берішілікті берген кезде туындайтын, міндеттемелердің толық қамтамасыз етілуін бақылау процедурасы жүргізілетінін, олар бойынша есеп айырысулар T+cp ретінде анықталатын күнге келетінін, мұндағы T – мәміле жасалған күн, ал cp – репо операциясының ашылу және жабылу күндері арасындағы күнтізбелік күндер санын анықтайды;
- 8) "B0" есеп айырысу коды деп ОК-сыз жазылу, жария ұсыныс әдісімен Биржа өткізетін сауда-саттықта не туындайтын міндеттемелерді қамтамасыз етуді бақылау рәсімі орындауға есеп беру кезінде жүргізілетінін, есеп айырысуды жүзеге асыру күні мәмілелер жасалған

күнге сәйкес келетінін айқындайтын, олар бойынша міндеттемелер гросс-негізде орындалуға жататын қаржы құралдарын орналастыру, сатып алу, сатып алу, сату жөніндегі мамандандырылған сауда-саттықта мәмілелер жасасу кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*;

- 8-1) "Bz" есеп айырысу коды деп ОК-сыз жазылу, жария ұсыныс әдісімен Биржа өткізетін сауда-саттықта не туындайтын міндеттемелерді қамтамасыз етуді бақылау рәсімі орындауға есеп беру кезінде жүргізілетінін, есеп айырысуды жүзеге асыру күні мәмілелер жасалған күннен ерекшеленетінін айқындайтын, олар бойынша міндеттемелер гросс-негізде орындалуға жататын қаржы құралдарын орналастыру, сатып алу, сатып алу, сату жөніндегі мамандандырылған сауда-саттықта мәмілелер жасасу кезінде пайдаланылатын есеп айырысу коды түсініледі *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен енгізілген)*;
- 9) толық қамту деп мәмілелер жасасу шарты түсініледі, бұл ретте олар орындалған кезге дейін туындайтын қаржы құралдарында осы қорытынды нәтижесінде туындайтын міндеттемелер бойынша толық қамтамасыз етудің болуын тексеру жүзеге асырылады *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*;
- 10) гросс-негіздегі клиринг деп, сауда-саттыққа қатысушы жеке жасаған әрбір мәміле бойынша орындауға жататын, талаптар мен міндеттемелерді анықтау үдерісі түсініледі;
- 11) орындауға арналған есеп деп, сауда-саттыққа қатысушының бұрын жасалған мәмілелер нәтижесінде туындаған міндеттемелерді орындауға дайындығын куәландыратын, сауда-саттыққа қатысушысы немесе Биржа маклері сауда-клирингілік жүйесіне берген есеп түсініледі.
2. Осы Тәртіппен пайдаланылатын өзге де ұғымдар Қазақстан Республикасының заңнамасында және Биржаның басқа да ішкі құжаттарында анықталған ұғымдарға ұқсас.

2 бап.

Негізгі қағидалар

1. Осы Тәртіп репо операцияларын ашу және жабу мәмілелеріне, сондай-ақ ОК-сыз сауда-саттық тәртіптемесінде қаржы құралдарын орналастыру, сатып алу, сатып алу, сату бойынша жазылу, жария ұсыныс және мамандандырылған сауда-саттық әдісімен Биржа өткізетін сауда-саттық шеңберінде жасалған мәмілелерге қолданылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
2. ОК-сыз сауда-саттық тәртіптемелерінің тізбесі Биржаның "ASTS+ сауда-клирингілік жүйесінің сауда-саттық тәртіптемелерінің және операцияларының тізімдері" атты ішкі құжатында (бұдан әрі – Сауда-саттық тәртіптемелерінің тізімі) анықталған *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
3. ОК-сыз әрбір сауда-саттық тәртіптемесі келесі ақпаратты қамтиды:
 - 1) мәміленің түрі (сатып алу – сату/ репо операциясы);
 - 2) Сауда-саттықты өткізу әдісі (үздіксіз қарсы аукцион әдісі/Тікелей мәмілелер жасасу әдісі, бұл әдістер ASTS+ сауда-клирингілік жүйесінде сауда-саттықты өткізу әдістері туралы қағидада сипатталған);

- 3) есептесу коды;
- 4) есептесу валютасы;
- 5) бағалы қағаздың атауы.
4. Сауда-саттық тәртіптемелерінде ОК-сыз саудаланатын бағалы қағаздар түріне қарай Сауда-саттық тәртіптемелерінің тізімінде белгіленген қаржы құралдарының топтары бойынша бөлінеді *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
5. *(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен алынып тасталған)*.
6. Мәмілелер есеп айырысуға олар сауда-клирингілік жүйесінде жасалған күні немесе репо жабу мәмілелері бойынша орындауға арналған есептерді алғаннан кейін немесе бірінші символы "В" болатын есеп айырысу коды бар мәмілелер бойынша орындалатын күн мен уақыт басталған кезде жіберіледі.
7. Мәмілелерді орындау кезінде қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингілік қызметті жүзеге асырудың шарттары мен тәртібін регламенттейтін клирингілік ұйымының ішкі құжатында белгіленген ерекшеліктерді ескере отырып, гросс-негіздегі клиринг процедуралары қолданылады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
8. Мәмілелерді есептеу олар бойынша нақты уақыт тәртіптемесінде төлемге қарсы жеткізу принципі бойынша толық қамтамасыз етілген жағдайда, әрбір жеке мәміле негізінде сауда-саттыққа қатысушылардың басқа мәмілелері бойынша талаптар мен міндеттемелерді өзара есепке алмастан, оларды сауда-клирингілік жүйеде тіркеу кезектілігі тәртібімен жүзеге асырылады.
9. Орталық депозитарий бағалы қағаздармен мәмілелер бойынша есеп айырысуды Орталық депозитарий осы клирингілік ұйымымен жасасқан келісім-шартпен реттелетін клирингілік ұйымының бұйрықтары негізінде оның жиынтығына сәйкес әрбір мәміле бойынша жеке жүзеге асырады *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
10. *(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен алынып тасталған)*.

3 бап.

Сауда-саттыққа қатысушылар

Бағалы қағаздардың сауда-саттықтарына қатысушылар мынадай топтарға бөлінеді:

- 1) Биржа мүшелері "қор нарығының мүшесі" санаты бойынша жататын бірінші топ – Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері, "Қазақстанның Даму Банкі" АҚ, Еуразиялық даму банкі және "Қазпошта" АҚ *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*;
- 2) екінші топқа, банктер болып табылмайтын "қор нарығының мүшесі" санатына иеленген, Биржа мүшелері жатады.

4 бап. Сауда-саттыққа қатысушыларының сауда-клирингілік шоттары

1. Бағалы қағаздар бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру үшін сауда-саттыққа қатысушының Орталық депозитарийде осы жеке шот шеңберінде ашылған жеке шоты және қосалқы шоты¹ болуы тиіс.
2. Бағалы қағаздар бойынша есеп айырысулар сауда-саттыққа қатысушының Орталық депозитарийдегі қосалқы шотында ашылған KASE бөлімінен жүзеге асырылады.
3. Ақша бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру үшін бірінші топтың қатысушысы "Қазақстан банкаралық есеп айырысу орталығы" РМК банкаралық ақша аудару жүйесінде (бұдан әрі – ҚБЕО БААЖ) позициясы², екінші топтың қатысушысы – Орталық депозитарийдегі банк шоты (меншікті³ және клиенттік біріктірілген⁴) болуға тиіс (*осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
4. ҚБЕО БДБЖ-дағы жайғасым және Орталық депозитарийдегі банктік шоттар ақшаны алдын ала жеткізу жүзеге асырылатын шоттар (бұдан әрі – алдын ала төлем шоттары) болып табылады.
5. Орталық депозитарийде ашылған сауда-саттыққа қатысушының немесе бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушының әрбір қосалқы шотына Биржаның сауда-клирингілік жүйесінде ашылатын сауда-клирингілік шоты сәйкес келеді. Сауда-клирингілік шотының коды Биржа мүшелеріне және олардың шоттарына, сауда-саттық жүйелерін пайдаланушыларға, Бағалы қағаздар эмитенттеріне және Биржаның қаржы құралдарына қысқартылған кодтар беру тәртібін анықтайтын Биржаның ішкі құжатына сәйкес беріледі.

Сауда-клирингілік шотта сауда-саттыққа қатысушының және/немесе оның клиенттерінің сауда-саттықта жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысуды жүзеге асыруға арналған бағалы қағаздар мен ақша ескеріледі.

Бағалы қағаздардың жекелеген атаулары және әртүрлі валютадағы ақша сауда-клирингілік жүйесіндегі бір сауда-клирингілік шотта ескеріледі.

5 бап. Сауда-клирингілік шоттарға қалдықтар туралы ақпарат енгізу

1. Күн сайын, әр сауда-саттық күнінің Алматы уақытымен 08.00-ден кешіктірмей Биржаның сауда-клирингілік жүйесіне қаржы құралдарының саны және сауда-саттыққа қатысушылар мен олардың клиенттерінің ақшасының саны (бастапқы қалдықтар) туралы ақпарат енгізіледі.
2. Бағалы қағаздар бойынша бастапқы қалдықтар клирингілік ұйым берген мәліметтерге сәйкес енгізіледі (*осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
3. Ақша бойынша бастапқы қалдықтар алдыңғы сауда-саттық күнінен ауыстырылады, сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушысы мен бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушысы дербес түрде енгізе алады.

¹ Қосалқы шоттарда сауда-саттыққа қатысушының меншікті бағалы қағаздары немесе оның клиенттерінің бағалы қағаздары есепке алынады.

6 бап. Биржаның сауда-клирингілік жүйесіндегі сауда-саттыққа қатысушылардың жайғасымдары

1. Биржаның сауда-клирингілік жүйесінде ақшаны есепке алу үшін (әрбір валюта бөлігінде) сауда - саттыққа қатысушылардың сауда-клирингілік шотында мынадай жайғасымдар пайдаланылады:
 - 1) алдыңғы сауда-саттық күнінен бастап ауыстырылатын немесе сауда-саттыққа қатысушы дербес енгізетін ақпарат туралы ақпарат орталық депозитарийдегі банк шотындағы немесе ҚБЕО-дағы позициядағы ақша санын (кіріс ақша позициясы) көрсететін кіріс позициясы *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*;
 - 2) сауда-саттыққа қатысушыдан "Z0" және "B0" есеп айырысу кодтарымен жасалған мәмілелер нәтижесінде, сондай-ақ сауда-саттыққа қатысушы сауда-саттық күнінің ағымдағы сәтінде Биржаның сауда-клирингілік жүйесінде жүргізген ақшаны сыртқы есепке алу/есептен шығару және ішкі ақша аударымдары нәтижесінде түскен немесе кеткен ақшаны ескере отырып, кіріс жайғасымын көрсететін ағымдағы жайғасым *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*;
 - 3) сауда-саттыққа қатысушының ағымдағы жайғасымындағы ақша санының және сауда-саттыққа қатысушының сауда-клирингілік жүйесіне берген, "Z0" есеп айырысу коды бар сатып алуға арналған белсенді өтінімдердің параметрлеріне сүйене отырып, бұғатталған ақша санының және "Z0" және "B0" есеп айырысу кодтары бар сатып алуға арналған мәмілелер бойынша орындауға қойылған есептер бойынша ақша санының айырмасы ретінде, Биржаның сауда-клирингілік жүйесі есептейтін жоспарлы және есептесушілік жайғасымдар *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
2. Сауда-клирингілік жүйесінде бағалы қағаздарды есепке алу үшін мынадай жайғасымдар пайдаланылады:
 - 1) "Z0", "B0" және "Bz" есеп айырысу кодтарымен есептелген мәмілелерді ескере отырып және бағалы қағаздар бойынша сыртқы аударымдарды ескере отырып, клирингілік ұйым сауда-саттыққа қатысушының Орталық депозитарийдегі шоттарындағы KASE және РЕПО бөлімдеріндегі бағалы қағаздардың санын көрсететін кіріс позициясы;
 - 2) Сауда-саттыққа қатысушының Орталық депозитарийдегі шоттарындағы KASE және РЕПО бөлімдеріндегі бағалы қағаздардың санын көрсететін ағымдағы позиция, олар туралы ақпаратты "T0", "Yn", "Z0", "B0" және "Bz" есеп айырысу кодтарымен жасалған мәмілелер нәтижесінде шығып қалған бағалы қағаздарды, сондай-ақ сауда-саттық күнінің қазіргі сәтінде Биржаның сауда-клирингілік жүйесінде сауда-саттыққа қатысушы жүргізген өзге операциялар ескере отырып, сауда-саттық күні ішінде клирингілік ұйым Биржаға ұсынады;
 - 3) осы сауда-саттыққа қатысушы Биржаның сауда-клиринг жүйесіне берген "T0" және "Z0" есеп айырысу кодтарымен сатуға арналған белсенді өтінімдердің параметрлерін және "Z0", "B0" және "Bz" есеп айырысу кодтарымен орындауға ұсынылған есептерді ескере отырып (шегере отырып), сауда-саттыққа қатысушының ағымдағы позициясына орай Биржаның сауда-клирингілік жүйесі есептейтін жоспарлы позиция;
 - 4) ағымдағы сауда-саттық күніне келетін есеп айырысу күнімен ішінара қамтамасыз етілген мәмілелер бойынша нетто, сауда-саттыққа қатысушының жоспарлы жайғасымына сүйене отырып, Биржаның сауда-клирингілік жүйесі есептейтін, есеп айырысу жайғасымы;

- 5) Биржаның сауда-клирингтік жүйесі есептейтін Т+ жоспарлы жайғасымы мәмілелер бойынша тиісті есеп айырысу күнін ескере отырып және тиісті есеп айырысу күнімен бағалы қағаздарды сатуға белсенді өтінімдер бойынша міндеттемелерді алып тастаумен есеп айырысудың алдыңғы күніндегі Т+ жоспарлы жайғасымына сүйене отырып есептеледі. Ағымдағы есеп айырысу күніне Т+ жоспарлы жайғасымы есеп айырысу жайғасымының мәні ретінде есептеледі.

7 бап.

Берілген өтінімді тексеру және оны қабылдау

1. Биржаның сауда-клирингтік жүйесі автоматтандырылған тәртіптемесінде әрбір берілген өтінімді және/немесе жайғасымдардың шектелімдерін сақтау және міндеттемелерді орындау мүмкіндігі туралы есептерді тексереді.
2. Осы баптың 1 тармағына сәйкес жүргізілген тексерудің теріс нәтижесі болған жағдайда, сауда-клирингтік жүйесі өтінімді және/немесе міндеттемелерді орындауға арналған есепті болдырмайды (қабылдамайды).
3. Осы баптың 1 тармағына сәйкес жүргізілген тексерудің оң нәтижесі болған жағдайда, сауда-клирингтік жүйесі өтінімді және/немесе есепті орындауға қабылдайды және автоматтандырылған тәртіптемеде мынадай әрекеттерді орындайды:
 - 1) осы өтінімді/міндеттемелерді орындауға арналған есепті қамтамасыз ету ретінде ақшаны және/немесе бағалы қағаздарды бұғаттайды;
 - 2) осы өтінімді/міндеттемелерді орындауға арналған есепті берген сауда-саттыққа қатысушының жоспарлы және есептесу жайғасымдарының мәндерін осы өтінімнің/орындауға арналған есептің мөлшеріне өзгертеді.
4. Сауда-саттыққа қатысушылар позицияларының шектелімдерінің сақталуын бақылау клирингтік ұйымнан алынған бағалы қағаздар туралы ақпаратты, Биржаның сауда-клирингтік жүйесі жүзеге асыратын олардың кіріс, ағымдағы және жоспарлы позицияларын тексеру арқылы сауда-саттыққа қатысушылардан алынған ақша туралы ақпаратты ескере отырып жүзеге асырылады (*осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).
5. Жазылу, жария ұсыныс әдісімен немесе бағалы қағаздарды орналастыру, сатып алу, өтеуін төлеп алу немесе сату бойынша мамандандырылған сауда-саттық әдісімен сауда-саттыққа қатысушылар берген өтінімдерді осындай сауда-саттық нәтижелері бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру үшін ақшаның немесе бағалы қағаздардың жеткіліктілігі мәніне тексеруді, егер мұндай сауда-саттық үшін "Z0" есеп айырысу коды белгіленген жағдайда, не орындауға есеп беру сәтінде осындай сауда-саттық үшін "B0" немесе "Bz" есеп-қисап коды белгіленген жағдайда өтінім беру сәтінде Биржаның сауда-клиринг жүйесі жүзеге асырады (*осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген*).

8 бап.

Мәмілелер жасасу және олар бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру

1. Мәмілені жасасу және осы мәміле жасалған сауда-клирингтік шотында автоматтандырылған тәртіптемеде Биржаның сауда-клирингтік жүйесінде орындау үшін есептерді орындауға қабылдау кезінде:
 - 1) бағалы қағаздың жеке атауы бойынша жайғасым қалыптасады;
 - 2) ақша бойынша ағымдағы, жоспарлы және есеп айырысу жайғасымдардың және бағалы қағаздар бойынша кіріс жайғасымдарының мәндері өзгертіледі.

2. Биржаның сауда-клиринглік жүйесінде мәміле жасау фактісі тіркелген сәтте және/немесе есепті орындауға қабылдау сәтінде клиринглік ұйым мәміле бойынша есеп айырысуды жүзеге асыруға бұйрықты қалыптастырады және Орталық депозитарийге жібереді. Бұйрық позициялардың шектелімдері және міндеттемелерді орындау мүмкіндігі сақталған жағдайда қалыптастырылады және төмендегілер ескеріле отырып жіберіледі *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*:
 - 1) әрбір мәміле бойынша немесе әрбір есеп бойынша орындауға бір бұйрық қалыптастырылады және жіберіледі;
 - 2) бұйрықты қалыптастыру және жолдау мәміле жасау немесе орындауға есеп алу фактісін сауда-клиринглік жүйесінде тіркеу тәртібімен жүзеге асырылады;
 - 3) мәміле бойынша есеп айырысуды жүзеге асыруға бұйрықтың форматы, құрылымы мен мазмұны клиринглік ұйым мен Орталық депозитарий арасындағы тиісті келісім-шартпен анықталады *(осы тармақша Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
3. Орталық депозитарий клиринглік ұйымның бұйрығы негізінде және өзінің ішкі құжаттарына сәйкес әрбір жіберілген бұйрық бойынша есеп айырысуды жүзеге асырады, бұл туралы клиринглік ұйымға есеп жібереді, ол осы есепті Биржаның сауда-клиринглік жүйесіне береді *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
4. Клиринглік ұйымнан бұйрықтың орындалуы туралы оң есепті алғаннан кейін Биржаның сауда-клиринглік жүйесінде бағалы қағаздар бойынша кіріс, ағымдағы, жоспарлы және есептік позициялардың мәні және ақша бойынша ағымдағы, жоспарлы, есептік позицияның мәні өзгереді.

Клиринглік ұйымнан бұйрықтың орындалуы туралы теріс есепті алғаннан кейін Биржа бұл туралы Биржаның сауда-клиринглік жүйесі бойынша жіберілетін хабарламалар немесе байланыстың өзге де ықтимал тәсілдері арқылы осы мәмілені жасасқан сауда-саттыққа қатысушыларды хабардар етеді.

(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)
5. Зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушы өз қалауы бойынша осы мәмілені бұзуға немесе осы мәміле бойынша есеп айырысуды қайта жүзеге асыруға келісуге құқылы.

Мәмілені бұзу зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушының шешімі бойынша Биржа сауда-клиринглік жүйеге берілген осындай бұзу туралы хабарламаны алғаннан кейін жүзеге асырылады.

Орындалмаған мәміле бойынша қайталама есеп айырысулар осындай мәміле тараптарының өзара келісімі кезінде Биржа осы мәміле тараптарының әрқайсысының сауда-клиринглік жүйесіне берген, оларды жүзеге асыруға келісетіні туралы хабарламаларды алғаннан кейін жүзеге асырылады.
6. Клиринглік ұйымнан осы баптың 4 тармағында көзделген ақпаратты алған кезге дейін репо операцияларын ашу мәмілелерін жасасу кезінде сауда-саттыққа қатысушылардың активтерді бірнеше рет пайдалануын болдырмау мақсатында мұндай сауда-саттыққа қатысушылардың жоспарлы және есептік позициялары осы мәміленің параметрлері ескеріле отырып есептеледі *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.

9 бап. Сауда-саттық барысында жайғасымдарды өзгерту

1. Биржаның сауда-клирингілік жүйесі сауда-саттыққа қатысушыға, егер осындай өзгерістің нәтижесінде сауда-клирингтік шоттың бір немесе бірнеше жайғасымдары бойынша шектелімдер бұзылған жағдайда, ағымдағы жайғасымды өзгертуге мүмкіндік бермейді.
2. Сауда-саттық барысында сауда-саттыққа қатысушылардың Орталық депозитарийдегі және сауда-клирингілік жүйесіндегі өздерінің қосалқы шоттарындағы бағалы қағаздардың санын өзгертуге мүмкіндігі бар.
3. Сауда-саттыққа қатысушылардың қосалқы шоттарындағы KASE бөліміндегі бағалы қағаздар санының ұлғаюы туралы ақпаратты клирингілік ұйым осындай өзгерістен кейін Биржаның сауда-клирингілік жүйесіне дереу береді *(осы абзац Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.

Сауда-клирингілік жүйеде бағалы қағаздар санының ұлғаюы туралы ақпарат негізінде бағалы қағаздар бойынша кіріс, ағымдағы, жоспарлы және есеп айырысу жайғасымдарын мәндері өзгереді.

4. Орталық депозитарийдегі сауда-саттыққа қатысушының қосалқы шотындағы KASE бөліміндегі бағалы қағаздар санын азайтуға сұрау салуды Орталық депозитарий депонентінің тиісті бұйрығын алғаннан кейін Орталық депозитарий клирингілік ұйымға жібереді.

Клиринг ұйымы Орталық депозитарийдің сұрау салуы негізінде осындай қатысушы позицияларының шектелімдерінің сақталуын тексереді.

Оң тексеру болған жағдайда клирингілік ұйымы осындай есептен шығаруға арналған сұрау салуға сәйкес бағалы қағаздарды толық мөлшерде есептен шығаруды мақұлдайды және сауда-клирингілік шотындағы бағалы қағаздар бойынша кіріс, ағымдағы, жоспарлы және есеп айырысу позициясын осы мөлшерге азайтады.

Теріс тексеру болған жағдайда клирингілік ұйымы бағалы қағаздарды есептен шығарудан бас тартады.

(Осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)

5. Сауда-саттыққа қатысушының ҚБЕО БДБЖ немесе Орталық депозитарийдегі алдын ала төленген шоттарындағы ақша санының өзгеруі осындай қатысушының жайғасымдар шектелімдерінің сақталуын тексергеннен кейін ғана жүзеге асырылады.
6. Сауда-саттыққа қатысушының шоттарындағы жайғасымдардың өзгеруі немесе ақшаға билік етуге шектеулер қою нәтижесінде Биржаның сауда-клирингілік жүйесінде жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысуларды жүзеге асырмағаны үшін жауапкершілік, соның шоттарында ақшаға билік етуге шектеулер өзгертілген немесе белгіленген, мәміленің тарапына жүктеледі.

10 бап. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесі

1. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушылар осындай мәмілелерді міндетті түрде растауға тиіс шоттар бойынша сауда-клиринг жүйесінде жасалған бағалы қағаздарды сатып алу-сату мәмілелері мен репо операцияларын ашу мәмілелерін клирингілік ұйым осындай мәмілелер бойынша бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушылар тарапынан растаулар алынған (не сауда-саттық тәртіптемесіне сәйкес – растаудан бас тарту алынбаған) жағдайда ғана Орталық депозитарийге есеп

айырысуға жібереді *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.

2. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы Биржаның сауда-клиринглік жүйесіне репо операциясының ашылу мәмілесін және/немесе ОК-сыз сауда-саттық тәртіптемесінде мамандандырылған сауда-саттыққа, жазылу немесе жария ұсыныс әдісімен сауда-саттыққа қатысу үшін берілген өтінімді растауын (не сауда-саттық тәртіптемесіне сәйкес – растаудан бас тартуды) осындай пайдаланушылардың жұмыс уақытын регламенттейтін Биржаның ішкі құжатында белгіленген бақылау және қамтамасыз ету жүйесінің жұмысы аяқталатын уақыттан кешіктірмей жіберуі тиіс *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
3. Егер бақылау және қамтамасыз ету жүйесінің пайдаланушысы репо ашу мәмілесін растамаған жағдайда, мұндай мәмілені Биржаның "ASTS+ сауда-клиринглік жүйесінде репо операцияларын жүзеге асыру ережелері" ішкі құжатында қарастырылған тәртіппен сауда-саттыққа жауапты қатысушы дербес түрде орындайды.
4. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесінің жұмыс уақыты аяқталғанға дейін репо операциясын ашу мәмілесін растамаған бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы келесі жұмыс күнінен кешіктірмей Биржаға осындай расталмау себептері көрсетілген ресми хат ұсынуға міндетті.
5. Бақылау және қамтамасыз ету жүйесін пайдаланушы сауда-саттыққа қатысушыда ақшаның немесе бағалы қағаздардың болмауы себебінен репо операцияларын ашу мәмілесін растай алмайды, өйткені Биржаның сауда-клиринглік жүйесі одан репо операцияларын ашу мәмілелерін жасасуға өтінімдер қабылдау кезінде сауда-саттыққа қатысушысының жайғасымдар шектелімдерінің сақталуын бақылауды жүзеге асырады.

11 бап.

Мәмілелерді орындамағаны үшін жауаптылық

1. Сауда-саттыққа қатысушылар өздерінің шоттарында ақшаның немесе бағалы қағаздардың жеткіліксіздігі себебінен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды орындамағаны үшін жауапты болады.
2. Егер бағалы қағаздарды сатып алу-сату мәмілесі екінші есеп айырысу клиринглік сессияны жүзеге асыру басталғанға дейін орындалмаса, онда мұндай мәміле бұзылған деп танылады.
3. Сауда-саттыққа кінәлі қатысушы зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушыға Биржаның "Қазақстан Республикасының мемлекеттік қазынашылық міндеттемелерін орналастыру ережелері", "ASTS+ сауда-клиринглік жүйесінде сауда-саттық өткізу әдістері туралы қағида", "Бағалы қағаздарға жазылуды жүргізу ережелері" және "Бағалы қағаздардың жария ұсынысын өткізу ережелері" ішкі құжаттарында белгіленген мөлшерде айыппұл төлеуге міндетті (осы баптың 4 тармағында көрсетілген жағдайды қоспағанда, оның осы айыппұлды төлеу туралы талабы болған кезде) *(осы тармақ Биржаның Директорлар кеңесінің 2023 жылдың 26 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)*.
4. Егер сауда-саттыққа зардап шеккен қатысушы мәміле бойынша есеп айырысуды қайта жүзеге асырудан бас тартса немесе сауда-клиринглік жүйеге мәміле бойынша қайта есеп айырысуды жүзеге асыруға келісім беру туралы хабарлама жібермесе, зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушының кінәлі тараптан осы баптың 3 тармағында қарастырылған қандай да бір айыппұл төлеуді талап етуге құқығы жоқ.
5. ОК-сыз сауда-саттықта репо операцияларын ашу және жабу мәмілелерін жасау ерекшеліктері, сондай-ақ мұндай мәмілелерге қатысушылардың олар

бойынша міндеттемелерді тиісінше орындамағаны үшін жауапкершілігі "ASTS+ сауда-клирингтік жүйесінде репо операцияларын жүзеге асыру ережелері" атты Биржаның ішкі құжатымен белгіленеді.

6. Орындалмаған мәміле бойынша қайта есеп айырысу жүзеге асырылған жағдайда Биржа сауда-саттықтың кінәлі қатысушысына мынадай ықпалшараларды қолданады:
 - 1) сауда-саттыққа қатысушы мәмілелер бойынша қайта есеп айырысуды жүзеге асырудың екі жағдайына дейін күнтізбелік 30 күн ішінде жол берген жағдайда – ескерту;
 - 2) сауда-саттыққа қатысушы мәмілелер бойынша қайта есеп айырысуды жүзеге асырудың екі жағдайынан астам күнтізбелік 30 күн ішінде жол берген жағдайда – айлық есептік көрсеткіштің 50 еселенген мөлшері көлемінде айыппұл.

12 бап. Айыппұлдарды төлеу тәртібі

1. Мәміле бұзылған кезде кінәлі сауда-саттыққа қатысушы Биржаның ішкі құжаттарында белгіленген шарттарға сәйкес орындалмаған мәміле бойынша комиссиялық алымдардың толық сомасын және, Биржаның комиссиялық алымдарын төлеу бойынша берілетін қандай да бір жеңілдіктерді есепке алмай, Биржаға төлеуге міндетті.
2. Зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушы бағалы қағаздарды сатып алу-сату мәмілесі жасалған күннен бастап он жұмыс күні ішінде Биржаға кінәлі сауда-саттыққа қатысушыға осы мәмілені орындамағаны үшін айыппұл төлеу жөніндегі талаптардың бар екендігі туралы жазбаша хабарлама беруге құқылы. Бұл ретте:
 - 1) көрсетілген мерзім ішінде Биржа мұндай хабарламаны алмаған жағдайда, Биржа бұл фактіні зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушының осы мәміле бойынша кінәлі сауда-саттыққа қатысушыға талаптарының болмауының дәлелі ретінде бағалайды;
 - 2) көрсетілген мерзім ішінде Биржа осындай хабарламаны алған жағдайда, ол осындай хабарламаны алған күннен кейінгі екінші жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде кінәлі сауда-саттыққа қатысушыны айыппұл төлеу қажеттігі туралы хабардар етеді және оны төлеу үшін шотты ұсынады.
3. Кінәлі сауда-саттыққа қатысушы айыппұл сомасын осы баптың 2 тармағының 2) тармақшасында қарастырылған хабарламаны алған күннен кейінгі бесінші жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде Биржаның Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінде ашылған корреспонденттік шотына аударады.
4. Биржа осы баптың 3 тармағына сәйкес Биржаның корреспонденттік шотына айыппұл сомасы түскен күннен кейінгі екі жұмыс күні ішінде осы соманы айыппұл төлеу туралы талапта көрсетілген деректемелер бойынша зардап шеккен сауда-саттыққа қатысушыға аударады.
5. Қаржы құралдарымен мәмілелер жасау үдерісінде туындайтын айыппұл төлеу мәселелері бойынша келіспеушіліктерді қарау тәртібі Биржаның "Қаржы құралдарымен жасалған мәмілелерді жүзеге асыру барысында туындайтын даулар мен келіспеушіліктерді шешу тәртібі" атты жеке ішкі құжатында қарастырылған.

13 бап. Тұжырымды қағидалар

1. Осы Тәртіп және оған енгізілетін барлық өзгертулер және/немесе толықтырулар Биржаның интернет-ресурсында (www.kase.kz) орналастыру арқылы сауда-саттыққа қатысушылардың назарына жеткізіледі.
2. Осы Тәртіп қажеттілігіне қарай, бірақ осы Тәртіп қолданысқа енгізілген күннен бастап әрбір үш жылда кемінде бір рет актуалдылануға жатады.
3. Осы Тәртіпке енгізілетін өзгертулер мен толықтыруларды уақтылы енгізу үшін сауда-саттық бөлімшесі жауапты болады.

Басөқарма

Алдамберген А. Ө.