

УТВЕРЖДЕНЫ

Решением Общего собрания участников
ТОО «Клиринговый центр ЕТС»,
протокол № 3 от «3» ноября 2010г.

ПРАВИЛА КЛИРИНГА
Товарищества с ограниченной ответственностью
«Клиринговый центр ЕТС»

г.Алматы, 2010 г.

ОГЛАВЛЕНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	4
Статья 1. Определения	4
Статья 2. Общие положения.....	5
Статья 3. Документы, предоставляемые Клиринговому центру при заключении договоров	5
Статья 4. Регистрация Участников клиринга.....	6
Статья 5. Конфиденциальность.....	7
РАЗДЕЛ II. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА ПО СРОЧНЫМ КОНТРАКТАМ	8
ПОДРАЗДЕЛ II-I. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С УЧАСТНИКАМИ КЛИРИНГА	8
Статья 6. Порядок регистрации и аннулирования регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка	8
Статья 7. Отчеты, предоставляемые Участникам срочного рынка.....	8
ПОДРАЗДЕЛ II-II. ПОРЯДОК УЧЕТА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ.....	9
Статья 8. Клиринговые регистры.....	9
Статья 9. Учет обязательств по Срочным контрактам	9
Статья 10. Учет обязательств по перечислению денежных средств.....	10
Статья 11. Учет обязательств по возврату средств Страхового фонда.....	12
ПОДРАЗДЕЛ II-III. СИСТЕМА МЕР СНИЖЕНИЯ РИСКОВ НЕИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ	12
Статья 12. Риски неисполнения Срочных контрактов	12
Статья 13. Меры по снижению рыночных рисков	12
Статья 14. Меры по снижению кредитных рисков Участников срочного рынка	14
Статья 15. Меры по снижению кредитных рисков Клирингового центра.....	15
Статья 16. Параметры системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов	15
ПОДРАЗДЕЛ II-IV. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С ОРГАНИЗАТОРОМ ТОРГОВЛИ	15
Статья 17. Порядок передачи информации Бирже	15
Статья 18. Порядок взаимодействия с Биржей в процессе объявления заявок / заключения Срочных контрактов	16
ПОДРАЗДЕЛ II-V. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	16
Статья 19. Порядок проведения клиринговых сессий	16
Статья 20. Вариационная маржа.....	17
Статья 21. Премия	19
ПОДРАЗДЕЛ II-VI. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ (ПРЕКРАЩЕНИЯ) ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	19
Статья 22. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по перечислению денежных средств	19
Статья 23. Порядок досрочного прекращения обязательств по Срочным контрактам.....	20
Статья 24. Порядок исполнения Опционов	20
Статья 25. Порядок исполнения расчетных Фьючерсов в Дату исполнения	21
Статья 26. Порядок исполнения поставочных Фьючерсов в Дату исполнения	21
Статья 27. Порядок оплаты клиринговых услуг, услуг по организации торговли, уплаты штрафов	21
РАЗДЕЛ III. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА)	23
ПОДРАЗДЕЛ III-I. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА) ПО СДЕЛКАМ, ЗАКЛЮЧЕННЫМ В РЕЖИМЕ ТОРГОВЛИ Т+0 (Т+N).....	23
Статья 28. Общие положения	23
Статья 29. Порядок регистрации Торговых счетов.....	23
Статья 30. Коды торговых счетов.....	25
Статья 31. Порядок получения Клиринговым центром информации о количестве двойных складских свидетельств и сумме денежных средств, учитываемых на Торговых счетах	25
Статья 32. Порядок взаимодействия с Биржей в процессе объявления заявок / заключения Сделок с полным обеспечением.....	26
Статья 33. Порядок получения от Биржи информации о заключенных Сделках с товаром	26

Статья 34. Поручения на клиринг	26
Статья 35. Порядок проведения Клиринговых сессий	27
Статья 36. Порядок включения в клиринговый пул и определения подлежащих исполнению обязательств по Сделкам с товаром	27
Статья 37. Проведение расчетов по сделкам Расчетной организацией	28
Статья 38. Отчеты Клирингового центра	28
Статья 39. Порядок оплаты клиринговых услуг	28
ПОДРАЗДЕЛ III-II. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА) ПО ПОСТАВОЧНЫМ ФЬЮЧЕРСАМ.....	29
Статья 40. Порядок исполнения поставочных Фьючерсов.	29
РАЗДЕЛ IV. Дополнительные гарантии в Режиме классической биржевой торговли	30
ПОДРАЗДЕЛ IV-I. Специализированный биржевой аукцион	30
Статья 41. Гарантийное обеспечение.....	30
Статья 42. Внесение гарантийного обеспечения.....	30
Статья 43. Возврат гарантийного обеспечения	30
РАЗДЕЛ IV. ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ГАРАНТИИ В РЕЖИМЕ КЛАССИЧЕСКОЙ БИРЖЕВОЙ ТОРГОВЛИ	
ПОДРАЗДЕЛ IV-I. СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ БИРЖЕВОЙ АУКЦИОН	30
Статья 41. Гарантийное обеспечение.....	30
Статья 42. Внесение гарантийного обеспечения	30
Статья 43. Возврат гарантийного обеспечения	30

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга Товарищества с ограниченной ответственностью «Клиринговый центр ЕТС» (далее – Правила клиринга) определяют порядок осуществления Товариществом с ограниченной ответственностью «Клиринговый центр ЕТС» (далее – Клиринговый центр) клиринга Срочных контрактов и Сделок с товарами, включая порядок его взаимодействия с Участниками клиринга, Биржей, Расчетными организациями, в том числе регулируют отношения, связанные с заключением с Клиринговым центром Срочных контрактов, исполнением (прекращением) обязательств по Срочным контрактам и Сделкам с товарами.

Статья 1. Определения

Биржа -	Акционерное общество «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система», с которым Клиринговым центром заключен договор о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга.
Взнос в Страховой фонд -	средства, внесенные Участниками клиринга в Страховой фонд в соответствии с Положением о страховом и резервном фондах, являющимся приложением № 8 к Правилам клиринга.
Группа объединенных разделов -	группа разделов клиринговых регистров Участника срочного рынка, объединенных в учете Клирингового центра.
Законодательство -	действующее законодательство Республики Казахстан, которое включает в себя Конституцию Республики Казахстан, законодательные акты, подзаконные нормативные правовые акты, включая нормативные правовые акты Уполномоченного органа.
Клиент -	лицо, за счет которого исполняются Сделки с товаром или Срочные контракты.
Клиринговая сессия -	часть Рабочего дня (период времени), во время которой Клиринговый центр проводит определение взаимных обязательств (сбор, сверку, корректировку информации по Сделкам с товаром и/или Срочным контрактам), их зачет и расчеты по ним.
Рабочий день -	день, кроме выходного или праздничного дня, в который работают банки второго уровня в г.Алматы.
Расчетная организация -	банк второго уровня или организация, осуществляющая отдельные виды банковских операций, с которой Клиринговым центром заключены договоры о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга.
Резервный фонд -	фонд, состоящий из средств Клирингового центра и формируемый в соответствии с Положением о страховом и резервном фондах, являющимся приложением № 8 к Правилам клиринга.
Реестр сделок -	информация о Сделках с товаром и Поручениях на клиринг, передаваемая Биржей Клиринговому центру.
Реестр срочных контрактов -	информация о Срочных контрактах, передаваемая Биржей Клиринговому центру.
Сделка с полным обеспечением -	сделка с Товаром, заключенная на Торгах Биржи в Режиме торговли с расчетами T+0, за исключением Сделок с отложенным исполнением и Сделок с условием обратного выкупа.
Сделка с товаром -	Сделка с полным обеспечением или Сделка с отложенным исполнением или Сделка с условием обратного выкупа.

Сделка с гарантией оплаты	сделка купли-продажи Товара, заключенная в Режиме классической торговли, предусматривающая исполнение обязательств по оплате Товара с использованием расчетного счета Клирингового центра.
Спецификация срочного контракта -	документ, содержащий стандартные условия Срочного контракта.
Срочный контракт -	Срочный контракт, заключенный на Торгах Биржи в Режиме торговли на срочном рынке.
Страховой фонд -	фонд, состоящий из взносов Участников клиринга, формируемый в соответствии с Положением о страховом и резервном фондах, являющимся приложением № 8 к Правилам клиринга.
Торговый счет -	счет, открытый в Расчетной организации для учета денежных средств или двойных складских свидетельств и предназначенный для проведения расчетов по Сделкам с товаром и Срочным контрактам, заключенным на Торгах Биржи.
Уполномоченный орган -	центральный исполнительный орган, осуществляющий государственное регулирование и координацию в сфере торговой деятельности (в случае если предусмотрено Законодательством).
Участник клиринга -	лицо, заключившее договор об осуществлении клирингового обслуживания с Клиринговым центром.
Участник срочного рынка -	Участник клиринга, зарегистрированный Клиринговым центром в качестве Участника срочного рынка в порядке, установленном Правилами клиринга.

Иные термины используются Правилами клиринга в значениях, определенных Законодательством, Правилами торговли Биржи, Правилами торговли в Секции срочного рынка Биржи, Спецификациями срочных контрактов.

Статья 2. Общие положения

- 2.1. Правила клиринга являются неотъемлемой частью договоров, ссылающихся на настоящие Правила клиринга.
- 2.2. Все приложения к Правилам клиринга являются их неотъемлемой частью.

Статья 3. Документы, предоставляемые Клиринговому центру при заключении договоров

- 3.1. Договор Клирингового центра с Участником клиринга, Расчетной организацией, Биржей, заключается при условии предоставления указанными юридическими лицами Клиринговому центру следующих документов:
 - а) нотариально удостоверенной копии учредительных документов юридического лица (Устава с отметкой о регистрации уполномоченного государственного органа и, в случае наличия, учредительного договора) (включая дополнения и изменения, действующие на дату заключения договора) с отметкой о регистрации юридического лица органами юстиции;
 - б) нотариально удостоверенной копии свидетельства о государственной регистрации юридического лица;
 - в) нотариально удостоверенной копии свидетельства налогоплательщика Республики Казахстан;
 - г) нотариально удостоверенной копии свидетельства о постановке на учет по налогу на добавленную стоимость (НДС) (в случае наличия);

- д) нотариально удостоверенной копии документа, подтверждающего избрание (назначение) лица, действующего от имени юридического лица без доверенности, или копии, заверенной печатью юридического лица;
- е) нотариально удостоверенной копии карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица;
- ж) доверенностей на лиц, имеющих право подписи от имени юридического лица (в случае необходимости);
- з) финансовой отчетности юридического лица на последнюю отчетную дату и установленных Законодательством приложений к ней, подписанных уполномоченными работниками юридического лица и заверенных его печатью.

В случае если предусмотренные настоящим пунктом документы были предоставлены юридическим лицом Бирже, предоставление их Клиринговому центру не требуется.

- 3.2. Для заключения с Клиринговым центром договора о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга Расчетная организация, помимо документов, перечисленных в пункте 3.1 настоящей статьи, предоставляет Клиринговому центру нотариально удостоверенную копию лицензии на осуществление банковских операций.
- 3.3. Для заключения с Клиринговым центром договора об осуществлении клирингового обслуживания (типовая форма приведена в приложении № 2 к Правилам клиринга) Участник клиринга помимо документов, перечисленных в пункте 3.1 настоящей статьи, предоставляет Клиринговому центру следующие документы:
 - а) подписанный со своей стороны договор об осуществлении клирингового обслуживания (в двух экземплярах);
 - б) Анкету Участника клиринга (по форме А01, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга);
 - в) нотариально удостоверенную копию лицензии на право занятия деятельностью товарных брокеров и(или) дилеров.
- 3.3.1. В случае изменения сведений, содержащихся в ранее поданной Анкете Участника клиринга или предоставленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан предоставить вновь заполненную Анкету Участника клиринга в течение 3 (трех) Рабочих дней после возникновения таких изменений, а также документы, в которые были внесены изменения, с учетом таких изменений. При этом документы, в которые были внесены изменения, предоставляются с соблюдением требований, предусмотренных пунктом 3.1 настоящей статьи.
- 3.3.2. В случае изменения содержащихся в Анкете Участника клиринга сведений, используемых Клиринговым центром при осуществлении клиринга, Клиринговый центр вправе приостановить осуществление клирингового обслуживания данного Участника клиринга до предоставления им вновь заполненной Анкеты.
- 3.3.3. Участник клиринга несет риск отрицательных последствий, вызванных непредоставлением или несвоевременным предоставлением Клиринговому центру информации (документов) в соответствии с требованиями Правил клиринга.
- 3.3.4. Клиринговый центр не несет ответственности за причиненные убытки в случае:
 - наличия неполной либо недостоверной информации в документах, предоставленных в соответствии с требованиями настоящей статьи;
 - непредоставления документов в соответствии с требованиями подпункта 3.3.1 настоящей статьи.

Статья 4. Регистрация Участников клиринга

- 4.1. После заключения договора об осуществлении клирингового обслуживания Клиринговый центр регистрирует Участника клиринга.

- 4.2. При регистрации Клиринговый центр присваивает каждому Участнику клиринга код и информирует об этом Участника клиринга.
- 4.3. В информации, которой обмениваются в процессе взаимодействия Клиринговый центр и Биржа, может использоваться либо код участника торгов, либо код Участника клиринга.

Статья 5. Конфиденциальность

- 5.1. Клиринговый центр обязан соблюдать конфиденциальность следующей информации:
- а) о количестве двойных складских свидетельств и суммах денежных средств, учитываемых на Торговых счетах Участников клиринга и их Клиентов;
 - 1) о поручениях и иных документах, поданных Участником клиринга Клиринговому центру или в Расчетную организацию;
 - 2) об учитываемых Клиринговым центром обязательствах Участников клиринга и обязательствах Клирингового центра перед Участниками клиринга;
 - 3) о Сделках с товаром и Срочных контрактах, стороной которых является Участник клиринга.
- 5.2. Клиринговый центр раскрывает указанную в пункте 5.1 настоящей статьи информацию государственным органам, уполномоченным в соответствии с Законодательством на получение служебной и коммерческой тайны на основании их запросов.

РАЗДЕЛ II. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА ПО СРОЧНЫМ КОНТРАКТАМ

ПОДРАЗДЕЛ II-1. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С УЧАСТНИКАМИ КЛИРИНГА

Статья 6. Порядок регистрации и аннулирования регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка

- 6.1. Участник клиринга, внесший взнос в Страховой фонд в порядке и размере, установленном Положением о страховом и резервном фондах, являющимся приложением № 8 к Правилам клиринга, регистрируется Клиринговым центром в качестве Участника срочного рынка.
- 6.2. При регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка Клиринговый центр, дополнительно к коду, присвоенному в соответствии с пунктом 4.2 Правил клиринга, присваивает ему код Участника срочного рынка и открывает разделы клиринговых регистров, указанных в статье 8 Правил клиринга.
- 6.2.1. Информация о регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка и о присвоенном ему коде доводится до сведения Участника клиринга.
- 6.3. Аннулирование регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка осуществляется по решению Клирингового центра.
- 6.4. Аннулирование регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка осуществляется Клиринговым центром после закрытия всех разделов клиринговых регистров, открытых Клиринговым центром для учета взаимных обязательств, возникающих между Клиринговым центром и этим Участником срочного рынка.
- 6.5. Если после принятия Клиринговым центром решения об аннулировании регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка, Клиринговый центр учитывает кредиторскую задолженность перед Участником клиринга по перечислению денежных средств, Клиринговый центр в целях погашения этой задолженности вправе:
- перевести указанные денежные средства на банковский счет Участника клиринга, зарегистрированный в Клиринговом центре или указанный в договоре об осуществлении клирингового обслуживания;
 - в случае невозможности указанного перевода денежных средств, внести указанные денежные средства в депозит нотариуса.
- Осуществление действий, предусмотренных настоящим пунктом, считается надлежащим исполнением Клиринговым центром обязательств по перечислению денежных средств Участнику клиринга.

Статья 7. Отчеты, предоставляемые Участникам срочного рынка

- 7.1. Клиринговый центр формирует и предоставляет Участникам срочного рынка отчеты по итогам дневной и вечерней клиринговой сессии.
Спецификация форматов отчетов определена приложением № 4 к Правилам клиринга.
Отчеты предоставляются в электронном виде.
- 7.2. Отчеты могут быть предоставлены на бумажном носителе Участнику срочного рынка по его запросу в течение 3 (трех) Рабочих дней после получения запроса.
- 7.3. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам срочного рынка исправленные отчеты. При этом действительным считается последний направленный отчет.

ПОДРАЗДЕЛ II-II. ПОРЯДОК УЧЕТА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 8. Клиринговые регистры

- 8.1. Для учета взаимных обязательств, возникающий между Клиринговым центром и Участниками клиринга, являющимися Участниками срочного рынка, Клиринговый центр использует следующие клиринговые регистры:
- регистр учета позиций;
 - денежный регистр;
 - регистр учета Взносов в Страховой фонд.
- 8.2. Регистр учета позиций - клиринговый регистр, на котором учитываются неисполненные (не прекращенные) обязательства по Срочным контрактам, заключенным между Клиринговым центром и Участниками срочного рынка, срок исполнения которых не наступил.
- 8.3. Денежный регистр - клиринговый регистр, на котором в случаях, установленных Правилами клиринга, учитываются обязательства по перечислению денежных средств, возникающие между Участниками срочного рынка и Клиринговым центром.
- 8.4. Регистр учета Взносов в Страховой фонд - клиринговый регистр, на котором учитываются обязательства Клирингового центра по перечислению (возврату) Участникам срочного рынка денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд.
- 8.5. Для ведения дополнительного аналитического учета взаимных обязательств Клирингового центра и определенного Участника срочного рынка Клиринговый центр открывает в своем учете разделы клиринговых регистров.
- 8.6. Порядок открытия и закрытия разделов клиринговых регистров определен в приложении № 6 к Правилам клиринга.
- 8.7. Под закрытием раздела клирингового регистра понимается прекращение ведения Клиринговым центром аналитического учета взаимных обязательств Клирингового центра и определенного Участника срочного рынка.
- 8.8. Значения, учитываемые на разделах клиринговых регистров, подлежат отражению в отчетах Клирингового центра, предоставляемых Участникам срочного рынка в соответствии с Правилами клиринга.

Статья 9. Учет обязательств по Срочным контрактам

- 9.1. На разделе регистра учет позиций Клиринговым центром учитываются:
- код (обозначение) Срочного контракта;
 - объем обязательств по Срочным контрактам, выраженный в количестве Срочных контрактов, имеющих данный код (обозначение).
- 9.2. Количество Срочных контрактов учитывается со знаком, отвечающим за то, покупателем или продавцом по данным Срочным контрактам является Участник срочного рынка, для учета обязательств по отношению к которому Клиринговым центром открыт раздел регистра учета позиций.
Количество Срочных контрактов учитывается со знаком «минус», если Участник срочного рынка является продавцом, со знаком «плюс» - если покупателем.
- 9.3. Обязательства по заключенному Срочному контракту подлежат учету на разделе регистра учета позиций, код которого был указан Участником торгов в Заявке на заключение указанного Срочного контракта.

- 9.4. Обязательства по Фьючерсу, возникшие в результате исполнения Опциона, базовым активом которого является данный Фьючерс, подлежат учету на разделе регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по Опциону.
- 9.5. При возникновении обязательств по Срочным контрактам, по которым Участник срочного рынка является покупателем (продавцом), Клиринговый центр учитывает возникшие обязательства на разделе регистра учета позиций следующим образом:
- если на разделе регистра учета позиций не учитываются обязательства по Срочным контрактам с таким же кодом, как код Срочных контрактов, обязательства по которым возникли, то Клиринговый центр начинает учитывать возникшие обязательства по Срочным контрактам, по которым Участник срочного рынка является покупателем (продавцом) на разделе регистра учета позиций;
 - если на разделе регистра учета позиций учитываются обязательства по Срочным контрактам, по которым Участник срочного рынка является покупателем (продавцом), с таким же кодом, как код Срочных контрактов, обязательства по которым возникли, то объем обязательств, учитываемых на разделе регистра учета позиций, увеличивается на количество Срочных контрактов, обязательства по которым возникли;
 - если на разделе регистра учета позиций учитываются обязательства по Срочным контрактам, по которым Участник срочного рынка является продавцом (покупателем), с таким же кодом, как код Срочных контрактов, обязательства по которым возникли, Клиринговый центр осуществляет досрочное прекращение обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на разделе регистра учета позиций, и возникших обязательств по Срочным контрактам в порядке, определенном статьей 23 Правил клиринга.
- 9.5.1. При учете на разделе регистра учета позиций обязательств по Срочному контракту, по которому Участник срочного рынка является покупателем, значение, учитываемое на разделе регистра учета позиций, увеличивается на единицу.
- 9.5.2. При учете на разделе регистра учета позиций обязательств по Срочному контракту, по которому Участник срочного рынка является продавцом, значение, учитываемое на разделе регистра учета позиций, уменьшается на единицу.
- 9.6. Клиринговый центр может изменить учет обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций, открытых для учета обязательств по Срочным контрактам по отношению к Участнику срочного рынка, на основании заявления Участника срочного рынка по форме F05, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга или при применении к Участнику срочного рынка процедуры принудительного закрытия позиций в порядке, определенном приложением № 11 к Правилам клиринга.
- В этом случае обязательства по Срочному контракту снимаются Клиринговым центром с учета с одного раздела регистра учета позиций и ставятся на учет на другой раздел регистра учета позиций в порядке, определенном настоящей статьей для возникших обязательств по Срочному контракту.
- Изменение учета обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций на основании заявления Участника срочного рынка осуществляется Клиринговым центром, если такое изменение не приведет к несоблюдению определенного в статье 13 Правил клиринга условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам данного Участника срочного рынка.

Статья 10. Учет обязательств по перечислению денежных средств

- 10.1. На разделах денежного регистра Клиринговым центром учитывается либо кредиторская задолженность Клирингового центра перед Участником срочного рынка, отражающая обязательства Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка, либо дебиторская задолженность Участника срочного рынка перед Клиринговым центром, отражающая обязательства Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру.

Кредиторская задолженность учитывается со знаком «плюс», дебиторская – со знаком «минус».

- 10.2. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр учитывает возникшее обязательство Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка (обязательство Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру) на разделе денежного регистра следующим образом:
- если на разделе денежного регистра учитывается нулевое значение, то Клиринговый центр начинает учитывать кредиторскую (дебиторскую) задолженность на разделе денежного регистра в объеме возникшего обязательства;
 - если на разделе денежного регистра учитывается кредиторская (дебиторская) задолженность, то размер данной кредиторской (дебиторской) задолженности увеличивается на объем возникшего обязательства;
 - если на разделе денежного регистра учитывается дебиторская (кредиторская) задолженность, Клиринговый центр зачитывает возникшее обязательство Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка (обязательство Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру) с требованием Клирингового центра к Участнику срочного рынка (Участника срочного рынка к Клиринговому центру) о перечислении денежных средств, учитываемым на данном разделе денежного регистра. Зачет осуществляется на сумму, равную минимальному из двух значений: объема возникшего обязательства и объема дебиторской (кредиторской) задолженности, учитываемой на разделе денежного регистра. В результате такого зачета происходит либо уменьшение дебиторской (кредиторской) задолженности, учитываемой на разделе денежного регистра, либо на разделе денежного регистра начинает учитываться кредиторская (дебиторская) задолженность.
- 10.2.1. При учете на разделе денежного регистра обязательства Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка значение, учитываемое на разделе денежного регистра, увеличивается на объем указанного обязательства.
- 10.2.2. При учете на разделе денежного регистра обязательства Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру значение, учитываемое на разделе денежного регистра, уменьшается на объем указанного обязательства.
- 10.2.3. При осуществлении зачета обязательств, указанного в пункте 10.2 настоящей статьи, обязательства, учитываемые на разделе денежного регистра, зачитываются в порядке их возникновения.
- 10.3. Участник срочного рынка вправе изменить учет обязательств по перечислению денежных средств на разделах денежного регистра, подав в Клиринговый центр заявление по форме G03, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга. В этом случае обязательства по перечислению денежных средств снимаются Клиринговым центром с учета с одного раздела денежного регистра и ставятся на учет на другой раздел денежного регистра в порядке, определенном настоящей статьей для возникших обязательств по перечислению денежных средств. Изменение учета обязательств по перечислению денежных средств на разделах денежного регистра на основании заявления Участника срочного рынка осуществляется Клиринговым центром, если такое изменение не приведет к несоблюдению определенного в статье 13 Правил клиринга условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам данного Участника срочного рынка.
- 10.4. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр рассчитывает значение общей дебиторской или кредиторской задолженности, учитываемой Клиринговым центром по отношению к определенному Участнику срочного рынка. Указанное значение рассчитывается как сумма значений, учитываемых на разделах денежного регистра, открытых Клиринговым центром для учета обязательств по

перечислению средств, возникающих между данным Участником срочного рынка и Клиринговым центром.

Если рассчитанное значение положительное, то это означает наличие общей кредиторской задолженности в объеме, равном рассчитанному значению.

Если рассчитанное значение отрицательное, то это означает наличие общей дебиторской задолженности в объеме, равном абсолютному значению рассчитанного значения.

Статья 11. Учет обязательств по возврату средств Страхового фонда

11.1. На разделах регистра учета Взносов в Страховой фонд Клиринговым центром учитывается кредиторская задолженность Клирингового центра перед Участником срочного рынка, отражающая обязательства Клирингового центра по перечислению (возврату) Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд данного Участника срочного рынка. Кредиторская задолженность учитывается со знаком «плюс».

11.2. Порядок возникновения и прекращения (исполнения) обязательств по перечислению (возврату) Участникам срочного рынка денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд данных Участников срочного рынка, определен Положением о страховом и резервном фондах, являющимся приложением № 8 к Правилам клиринга.

11.3. Клиринговый центр учитывает возникшее обязательство Клирингового центра по перечислению (возврату) Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд данного Участника срочного рынка, на разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд следующим образом:

- если на данном разделе учитывается нулевое значение, то Клиринговый центр начинает учитывать кредиторскую задолженность Клирингового центра перед Участником срочного рынка в объеме возникшего обязательства;
- если на данном разделе денежного регистра учитывается кредиторская задолженность Клирингового центра перед Участником срочного рынка, то размер данной кредиторской задолженности увеличивается на объем возникшего обязательства.

11.3.1. Значение, учитываемое на разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, увеличивается на объем возникшего обязательства Клирингового центра по перечислению (возврату) Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд данного Участника срочного рынка.

ПОДРАЗДЕЛ II-III. СИСТЕМА МЕР СНИЖЕНИЯ РИСКОВ НЕИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ

Статья 12. Риски неисполнения Срочных контрактов

12.1. Основными рисками неисполнения Срочных контрактов являются рыночный риск и кредитный риск.

12.1.1. Рыночный риск возникает у стороны Срочного контракта при изменении рыночных показателей, влияющих на цену базового актива Срочного контракта.

12.1.2. Кредитный риск – это риск неплатежеспособности контрагента по Срочному контракту, включая риск временной потери ликвидности.

12.2. В целях снижения вышеперечисленных рисков Клиринговый центр создает систему мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов.

Статья 13. Меры по снижению рыночных рисков

13.1. Для снижения рыночных рисков Клиринговый центр:

- определяет Расчетные цены Срочных контрактов, по которым будут оцениваться рыночные риски, возникающие у контрагентов по Срочным контрактам (Участников срочного рынка и Клирингового центра);
 - рассчитывает рыночные риски (в денежном выражении), возникшие у контрагентов по Срочным контрактам, вызванные изменением Расчетных цен Срочных контрактов;
 - определяет и учитывает обязательства по перечислению Вариационной маржи с целью компенсации рассчитанных рыночных рисков, возникших у контрагентов по Срочным контрактам.
- 13.2. Определение Расчетных цен Срочных контрактов осуществляется Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения расчетной цены срочных контрактов, являющейся приложением № 7 к Правилам клиринга.
- 13.3. Расчет рыночных рисков и определение обязательств по перечислению Вариационной маржи проводится Клиринговым центром в ходе дневной и вечерней клиринговых сессий. В ходе данных клиринговых сессий:
- у Участников срочного рынка, создающих рыночные риски для Клирингового центра по Срочным контрактам, возникают обязательства перечислить Клиринговому центру сумму денежных средств, равную денежной оценке данных рисков (Вариационную маржу);
 - у Участников срочного рынка, несущих на себе рыночные риски Клирингового центра по Срочным контрактам, возникают права требования к Клиринговому центру о перечислении им суммы денежных средств, равной денежной оценке данных рисков (Вариационной маржи).
- 13.4. Для целей оперативного исполнения (прекращения) возникающих у Участников срочного рынка обязательств по перечислению Вариационной маржи и иных обязательств по перечислению денежных средств, возникающих в случаях, определенных Правилами клиринга, Клиринговый центр устанавливает и проверяет соблюдение условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам, являющегося необходимым для заключения Срочных контрактов с Участником срочного рынка и для наличия неисполненных обязательств по Срочным контрактам у Участника срочного рынка.
- 13.5. Оцениваемый Клиринговым центром объем обязательств по перечислению денежных средств, которые могут возникнуть у Участника срочного рынка по отношению к Клиринговому центру по Срочным контрактам по итогам двух ближайших дневных и/или вечерних клиринговых сессий, составляет Начальную маржу.
- 13.5.1. Клиринговый центр осуществляет расчет Начальной маржи:
- по обязательствам по Срочным контрактам, учитываемым на разделах регистра учета позиций, входящих в одну Группу объединенных разделов (далее – Начальная маржа для Группы объединенных разделов);
 - по обязательствам по Срочным контрактам, учитываемым на всех разделах регистра учета позиций, открытых Клиринговым центром для учета обязательств Участника срочного рынка, как сумму Начальной маржи для всех Групп объединенных разделов (далее – Начальная маржа для Участника срочного рынка).
- Значения Начальной маржи указываются Клиринговым центром в отчетах, предоставляемых по итогам дневной и вечерней клиринговой сессии в соответствии со статьей 7 Правил клиринга.
- 13.6. Условие обеспеченности обязательств по Срочным контрактам соблюдается, если объем общей кредиторской задолженности Клирингового центра перед Участником срочного рынка не меньше, чем значение Начальной маржи для Участника срочного рынка.

Условие обеспеченности обязательств по Срочным контрактам не соблюдается, если объем общей кредиторской задолженности Клирингового центра перед Участником срочного рынка меньше, чем значение Начальной маржи для Участника срочного рынка.

Статья 14. Меры по снижению кредитных рисков Участников срочного рынка

- 14.1. Контроль Клирингового центра за соблюдением условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам, является также мерой, направленной на снижение кредитных рисков, возникающих у Клирингового центра в отношении Участника срочного рынка.
- 14.1.1. Начальная маржа, рассчитываемая Клиринговым центром с целью осуществления контроля за соблюдением условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам, зависит от объема обязательств Участника срочного рынка по Срочным контрактам и от волатильности (изменчивости) цен данных Срочных контрактов.
- 14.1.2. Исходя из волатильности цен Срочного контракта, Клиринговый центр устанавливает Ставку начальной маржи по Срочному контракту, Верхний и Нижний лимиты колебаний цен Срочного контракта.
- 14.1.3. Ставка начальной маржи по Срочному контракту ограничивает потенциально возможный объем обязательства по перечислению Вариационной маржи, которое может возникнуть по Срочному контракту по итогам ближайшей дневной или вечерней клиринговой сессии.
- 14.1.4. Верхний и Нижний лимиты колебаний цен Срочного контракта ограничивают цены Срочных контрактов, заключаемых на Торгах.
- 14.1.5. Порядок изменения Клиринговым центром Ставки начальной маржи по Срочным контрактам, Верхнего и Нижнего лимитов колебаний цен Срочного контракта определяется приложением № 5 к Правилам клиринга.
- 14.2. Если в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии Клиринговым центром будет установлен факт несоблюдения условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам в отношении Участника срочного рынка, Клиринговый центр направляет такому Участнику срочного рынка отчет, содержащий информацию об этом факте. Направление указанного отчета является выставлением Клиринговым центром Маржинального требования Участнику срочного рынка.
- Маржинальное требование – это обязательство, в силу которого Участник срочного рынка обязан устранить необеспеченность обязательств по Срочным контрактам, а Клиринговый центр вправе требовать от Участника клиринга ее устранения.
- 14.3. Маржинальное требование может быть исполнено Участником срочного рынка за счет:
- перечисления денежных средств на счет Клирингового центра;
 - закрытия позиций - уменьшения объема неисполненных по отношению к Клиринговому центру обязательств по Срочным контрактам путем заключения Участником срочного рынка Срочных контрактов, приводящих к досрочному прекращению обязательств по Срочным контрактам, учитываемым на разделах регистра учета позиций, в порядке, определенном пунктом 10.2 Правил клиринга.
- 14.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником срочного рынка не позднее, чем за 45 минут до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии.
- 14.4.1. Клиринговый центр вправе продлить срок исполнения Маржинального требования до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии, в случае невозможности предоставления Расчетной организацией в Клиринговый центр информации о зачислении на счет Клирингового центра в соответствии с порядком, установленным договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией.

- 14.5. Если Маржинальное требование не будет исполнено Участником срочного рынка в срок, установленный в пункте 14.34 настоящей статьи, Клиринговый центр применяет к Участнику срочного рынка процедуру принудительного закрытия позиций, установленную приложением № 11 к Правилам клиринга.

Статья 15. Меры по снижению кредитных рисков Клирингового центра

- 15.1. Риск потери Клиринговым центром ликвидности реализуется в случае, если Клиринговым центром учитывается общая дебиторская задолженность одного или нескольких Участников срочного рынка перед Клиринговым центром.
- 15.2. Участник срочного рынка обязан погасить возникшую общую дебиторскую задолженность путем внесения денежных средств на счет Клирингового центра в течение одного Рабочего дня с момента ее возникновения.
- 15.3. В случае непогашения Участником срочного рынка общей дебиторской задолженности в срок, установленный пунктом 15.2 настоящей статьи, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление (требование) о приостановке доступа данного Участника срочного рынка к Торгам в Режиме торговли на срочном рынке и приступает к использованию средств Страхового и Резервного фондов в порядке, определенном приложением № 8 к Правилам клиринга. Указанное уведомление может являться основанием для применения Биржей к Участнику срочного рынка мер дисциплинарного воздействия.
- 15.4. Если общая дебиторская задолженность Участника срочного рынка признается Клиринговым центром сомнительным требованием в соответствии с Законодательством, Клиринговый центр относит ее на налоговые вычеты по корпоративному подоходному налогу.

Статья 16. Параметры системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов

- 16.1. По каждому Фьючерсу Клиринговый центр устанавливает следующие параметры системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов:
- Расчетную цену;
 - Ставку начальной маржи;
 - Верхний и Нижний лимиты колебаний цен.
- 16.2. Для Опционов, базовым активом которых является Фьючерс, параметры системы мер снижения рисков неисполнения указанного Фьючерса являются также параметрами системы мер снижения рисков неисполнения данного Опциона.
- 16.3. На момент начала первого Торгового дня, в ходе которого может быть заключен Срочный контракт, значения указанных параметров устанавливаются решением Клирингового центра, в остальных случаях – в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 16.4. Значения параметров системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов публикуются в сети Интернет по адресу <http://www.ets.kz>.

ПОДРАЗДЕЛ II-IV. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С ОРГАНИЗАТОРОМ ТОРГОВЛИ

Статья 17. Порядок передачи информации Бирже

- 17.1. Ежедневно, перед началом Торгов, Клиринговый центр передает Бирже:
- а) список кодов разделов регистров учета позиций, открытых на момент передачи указанного списка;
 - б) значения, учитываемые на разделах регистров учета позиций;

- в) значения, учитываемые на разделах денежного регистра, суммарно по каждой Группе объединенных разделов и по каждому Участнику срочного рынка;
 - г) значения Начальной маржи для каждой Группы объединенных разделов и для каждого Участника срочного рынка;
 - д) значения параметров системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов.
- 17.1.1. В случае изменения значений, указанных в подпунктах б-д пункта 17.1 настоящей статьи, в ходе Торгов Клиринговый центр незамедлительно передает Бирже указанные измененные значения.
- 17.1.2. Значения, указанные в подпунктах б-д пункта 17.1 настоящей статьи передаются Бирже с целью доведения до сведения Участников торгов.

Статья 18. Порядок взаимодействия с Биржей в процессе объявления заявок / заключения Срочных контрактов

- 18.1. При подаче Участником торгов Заявки с целью заключения Срочных контрактов Биржа направляет Клиринговому центру информацию о поданной Заявке.
- 18.2. При получении информации о Заявке, поданной с целью заключения Срочных контрактов, Клиринговый центр немедленно осуществляет проверку соблюдения условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам, которые будут учитываться на разделе регистра учета позиций, код которого указан в Заявке, после заключения Срочных контрактов на основании данной Заявки и ранее объявленных Заявок. Указанная проверка осуществляется для Группы объединенных разделов денежного регистра, код которой определяется кодом раздела регистра учета позиций, указанным в Заявке, и для Участника срочного рынка в целом.
- 18.3. В случае положительного результата проверки, указанной в пункте 18.2 настоящей статьи, Клиринговый центр направляет Бирже подтверждение возможности объявления Заявки, в случае отрицательного результата - отказ в объявлении Заявки.
- 18.4. В момент объявления Заявки, являющейся встречной по отношению к ранее объявленной Заявке, Клиринговый центр в порядке, определенном Правилами торговли в Секции срочного рынка Биржи, заключает Срочные контракты с Участниками торгов, объявившими встречные Заявки.
- 18.5. По Заявке, в отношении которой отсутствует объявленная встречная Заявка, Клиринговый центр вправе в порядке, определенном Правилами торговли в Секции срочного рынка Биржи, заключить Срочные контракты с Участником торгов, объявившим такую Заявку.

ПОДРАЗДЕЛ II-V. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 19. Порядок проведения клиринговых сессий

- 19.1. В каждый Рабочий день, в который Биржей проводятся Торги в Секции срочного рынка, Клиринговый центр проводит вечернюю клиринговую сессию и может проводить дневную клиринговую сессию в случае принятия решения о ее проведении.
- 19.2. Вечерняя клиринговая сессия проводится Клиринговым центром сразу после окончания Торгов в Секции срочного рынка.
- 19.3. Дневная клиринговая сессия (в случае принятия решения о ее проведении) проводится в ходе Торговой сессии в Секции срочного рынка в срок, установленный решением Клиринговым центром.
- 19.4. В ходе дневной клиринговой сессии Клиринговый центр:

- 1) осуществляет исполнение Опционов, по которым осуществлено востребование прав их Держателями;
 - 2) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций при проведении процедуры принудительного закрытия позиций;
 - 3) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций на основании заявлений Участников срочного рынка;
 - 4) определяет новые значения параметров системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов;
 - 5) определяет обязательства по перечислению Вариационной маржи и учитывает их на разделах денежного регистра;
 - 6) по Опционам, заключенным в период времени с момента окончания предыдущей и до момента начала текущей дневной или вечерней клиринговой сессии, учитывает обязательства по перечислению Премии на разделах денежного регистра;
 - 7) учитывает на разделах регистра учета позиций обязательства по Срочным контрактам, заключенным в период времени с момента окончания предыдущей и до момента начала текущей дневной или вечерней клиринговой сессии, и досрочно прекращает встречные однородные обязательства по Срочным контрактам;
 - 8) учитывает на разделах денежного регистра иные, кроме указанных в подпунктах 5), 6) настоящего пункта, обязательства по перечислению денежных средств, предусмотренные Правилами клиринга, Правила торговли в Секции срочного рынка Биржи и заключенными с Участниками срочного рынка и Биржей договорами;
 - 9) изменяет учет обязательств по перечислению денежных средств на разделах денежного регистра на основании поручений Участников срочного рынка;
 - 10) рассчитывает Начальную маржу;
 - 11) проверяет соблюдение условия обеспеченности обязательств по Срочным контрактам по каждому Участнику срочного рынка и, в случае несоблюдения, выставляет такому Участнику срочного рынка Маржинальное требование;
 - 12) формирует отчеты для Участников срочного рынка.
- 19.5. В ходе вечерней клиринговой сессии Клиринговый центр кроме действий, перечисленных в пункте 19.4 настоящей статьи:
- 1) прекращает учет на разделах регистра учета позиций обязательств по Опционам, прекращенных вследствие того, что право требования по ним не осуществлено их Держателями и у данных Опционов истек Срок действия;
 - 2) осуществляет исполнение расчетных Фьючерсов с наступившей Датой исполнения;
 - 3) осуществляет регистрацию и аннулирование регистрации Участников срочного рынка;
 - 4) осуществляет открытие и закрытие разделов клиринговых регистров.
- 19.6. Клиринг по Срочным контрактам осуществляется на основании Реестров срочных контрактов, полученных Клиринговым центром от Биржи.

Статья 20. Вариационная маржа

- 20.1. Обязательство по перечислению Вариационной маржи возникает между Клиринговым центром и Участником срочного рынка, имеющими непрекращенные обязательства по Фьючерсам.
- 20.2. Обязательства по перечислению Вариационной маржи возникают в ходе дневных и вечерних клиринговых сессии, проводимых Клиринговым центром.

20.3. Объем обязательства по перечислению Вариационной маржи по каждому Фьючерсу, обязательства по которому не прекращены, определяется в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии в следующем порядке:

20.3.1. Клиринговый центр рассчитывает сумму Вариационной маржи по Фьючерсу по следующим формулам:

$VM_{open} = (C_{settl} - C_{fut}) \times Lot \times Rate,$ $VM_{cur} = (C_{settl} - C_{prev}) \times Lot \times Rate,$ где:	
VM_{open}	сумма Вариационной маржи по Фьючерсу, по которому расчет Вариационной маржи Клиринговым центром еще не производился
VM_{cur}	сумма Вариационной маржи по Фьючерсу, по которому расчет Вариационной маржи Клиринговым центром уже производился
C_{settl}	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе текущей дневной или вечерней клиринговой сессии
C_{prev}	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе предыдущей дневной или вечерней клиринговой сессии
C_{fut}	Цена заключения Фьючерса
Lot	количество единиц базового актива Фьючерса (лот)
Rate	Курс валюты, в которой определяется Расчетная цена Фьючерса, к валюте Республики Казахстан (тенге). Если Расчетная цена Фьючерса определяется в тенге, то данный коэффициент равен 1 (единице). Если Расчетная цена Фьючерса определяется в валюте, отличной от тенге, то данный коэффициент равен официальному курсу соответствующей валюты к тенге, установленному Национальным Банком Республики Казахстан на день расчета

20.3.2. Объем обязательства по перечислению Вариационной маржи по Фьючерсу равен абсолютному значению суммы Вариационной маржи, округленному до сотых долей тенге (до тыинов) по правилам математического округления.

20.4. Если сумма Вариационной маржи положительная, то Продавец Фьючерса обязан перечислить сумму Вариационной маржи Покупателю Фьючерса.

20.5. Если сумма Вариационной маржи отрицательная, то Покупатель Фьючерса обязан перечислить абсолютное значение Вариационной маржи Продавцу Фьючерса.

20.6. Клиринговый центр учитывает обязательства по перечислению Вариационной маржи на разделах денежного регистра в порядке, установленном статьей 9.6 Правил клиринга для учета обязательств по перечислению денежных средств.

20.7. Клиринговый центр учитывает обязательство по перечислению Вариационной маржи на разделе денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитываются обязательства по Фьючерсу.

20.8. Прекращение обязательств по перечислению Вариационной маржи зачетом или исполнением осуществляется в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга.

20.9. Суммы перечисленной Вариационной маржи по Срочному контракту являются расходами по данному Срочному контракту. Суммы полученной Вариационной маржи являются поступлениями по данному Срочному контракту в соответствии с налоговым законодательством Республики Казахстан.

20.10. Прекращение обязательств по перечислению Вариационной маржи по поставочным Фьючерсам, обязательства по которым были прекращены досрочно, осуществляется в Дату досрочного прекращения обязательств.

20.11. Прекращение обязательств по перечислению Вариационной маржи по поставочным Фьючерсам, торги по которым были прекращены в Дату исполнения, осуществляется в Дату исполнения.

Статья 21. Премия

- 21.1. Обязательство по перечислению Премии возникает между Клиринговым центром и Участником срочного рынка, являющимися сторонами Опциона в момент его заключения.
- 21.2. Клиринговый центр учитывает обязательство по перечислению Премии на разделе денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, указанным в Заявке, на основании которой был заключен Опцион.
- 21.3. Клиринговый центр учитывает обязательства по перечислению Премии на разделах денежного регистра в ходе дневных и вечерних клиринговых сессий в порядке, установленном статьей 9.6 Правил клиринга для учета обязательств по перечислению денежных средств.
- 21.4. Прекращение обязательств по перечислению Премии зачетом или исполнением осуществляется в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ II-VI. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ (ПРЕКРАЩЕНИЯ) ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 22. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по перечислению денежных средств

- 22.1. Срок исполнения всех возникающих из Правил клиринга (и из заключенных Срочных контрактов) обязательств Участников срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру наступает в момент возникновения данных обязательств.
- 22.2. Обязательство Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру может быть исполнено (прекращено) путем:
- перечисления денежных средств на счет Клирингового центра в порядке, определенном приложением № 9 к Правилам клиринга;
 - зачета указанного обязательства с обязательством Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка в порядке, определенном статьей 9.6 Правил клиринга.
- 22.3. Срок исполнения всех возникающих из Правил клиринга (и из заключенных Срочных контрактов) обязательств Клирингового центра по перечислению денежных средств Участникам срочного рынка наступает в момент востребования – момент приема Клиринговым центром от Участника срочного рынка Заявления на возврат денежных средств по форме G02, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 22.4. Обязательство Клирингового центра по перечислению денежных средств Участнику срочного рынка может быть исполнено (прекращено) путем:
- перечисления денежных средств на счет Участника срочного рынка в порядке, определенном приложением № 9 к Правилам клиринга;
 - зачета указанного обязательства с обязательством Участника срочного рынка по перечислению денежных средств Клиринговому центру в порядке, определенном пунктом 9.6 Правил клиринга.
- 22.5. Перечисление денежных средств на счет Участника срочного рынка выполняется Клиринговым центром в случае, если оно не приведет к возникновению Маржинального требования у Участника срочного рынка и/или общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка.
- 22.6. Исполнение (прекращение) обязательств Участников срочного рынка или Клирингового центра по перечислению денежных средств осуществляется в порядке их возникновения.

Статья 23. Порядок досрочного прекращения обязательств по Срочным контрактам

23.1. При наступлении условий досрочного исполнения обязательств по Срочным контрактам, указанных в пункте 9.5 Правил клиринга, Клиринговый центр осуществляет прекращение данных обязательств следующим образом:

- Обязательств по двум Фьючерсам:
 - 1) обязательства по поставке/приобретению базового актива Фьючерсов (исполнению обязательства, указанного в спецификации Фьючерса) прекращаются;
 - 2) обязательства по оплате Вариационной маржи прекращаются. Выплаченная по данному Фьючерсу Вариационная маржа считается расходами. Полученная по данному Фьючерсу Вариационная маржа считается поступлениями в соответствии с налоговым законодательством Республики Казахстан;
- Обязательства по двум Опционам полностью зачитываются.

23.1.1. Обязательства по Срочным контрактам, по которым осуществляется прекращение обязательств, выбираются Клиринговым центром в порядке их возникновения.

23.1.2. Прекращение обязательств происходит во время ближайшей после наступления условий досрочного исполнения Клиринговой сессии.

Статья 24. Порядок исполнения Опционов

24.1. Исполнение Опционов проводится при получении Клиринговым центром, являющимся Подписчиком, от Участника срочного рынка, являющегося Держателем, заявления о востребовании прав по Опциону. Если исполнение Опциона приводит к возникновению у Участника срочного рынка Маржинального требования, Клиринговый центр вправе не принимать от Участника срочного рынка заявления о востребовании прав по Опциону.

24.1.1. Заявление о востребовании прав по Опциону подается Участниками срочного рынка с использованием Торговой системы. Биржа передает Клиринговому центру информацию о поданных заявлениях о востребовании прав по Опционам.

24.2. При получении от Биржи информации о поданном заявлении о востребовании прав по Опциону, Клиринговый центр осуществляет востребовании прав по Опциону такой же серии, по которому Клиринговый центр является Держателем.

24.2.1. Выбор Подписчика осуществляется Клиринговым центром по дате и времени заключения Опционов, начиная с самых ранних.

24.3. В результате исполнения поставочного Опциона, базовым активом которого является Фьючерс, у Участника срочного рынка и Клирингового центра возникают обязательства по Фьючерсу, являющемуся базовым активом Опциона.

Цена Фьючерса, являющегося базовым активом Опциона, равна цене исполнения Опциона (цене страйк). Указанная цена учитывается для определения в соответствии с Правилами клиринга обязательств по перечислению Вариационной маржи по Фьючерсу, обязательства по которому возникли в результате исполнения Опциона.

Учет обязательств по Фьючерсу, возникших в результате исполнения Опциона, осуществляется в соответствии со статьей 9 Правил клиринга по коду (обозначению) Фьючерса.

Учет обязательств по исполненному Опциону на разделе регистра учета позиций прекращается.

24.3.1. Если обязательства по Фьючерсу, возникшие в результате исполнения Опциона, не были прекращены в порядке, определенном статьей 23 Правил клиринга, Вариационная маржа по данному Фьючерсу рассчитывается в порядке, определенном статьей 19.6 Правил клиринга.

- 24.3.2. Прекращение обязательств по Фьючерсу, возникших в результате исполнения Опциона, осуществляется в порядке, установленном статьями 23, 25 или 26 Правил клиринга.

Статья 25. Порядок исполнения расчетных Фьючерсов в Дату исполнения

В Дату исполнения по расчетному Фьючерсу наступает срок исполнения обязательств по Фьючерсу и возникают обязательства с наступившей датой исполнения, установленные Спецификацией Фьючерса. Обязательство по оплате Вариационной маржи прекращается. Выплаченная по данному Фьючерсу Вариационная маржа считается расходами. Полученная по данному Фьючерсу Вариационная маржа считается поступлениями в соответствии с налоговым законодательством Республики Казахстан;.

- 25.1. Прекращение обязательств происходит во время вечерней Клиринговой сессии в Дату исполнения

Статья 26. Порядок исполнения поставочных Фьючерсов в Дату исполнения

- 26.1. Особенности исполнения обязательств по поставочным Фьючерсам могут устанавливаться решением Биржи о возможности заключения указанного Фьючерса на Торгах.

- 26.2. В Дату исполнения Клиринговый центр включает в клиринговый пул обязательства по поставочным Фьючерсам с наступившей Датой исполнения, базовым активом которых является Товар.

Необходимые условия для включения указанных обязательств в клиринговый пул определяются Спецификацией Фьючерса.

- 26.3. Исполнение (прекращение) включенных в клиринговый пул обязательств по поставочным Фьючерсам с наступившей Датой исполнения, базовым активом которых является Товар, осуществляется в порядке, определенном разделом III Правил клиринга.

- 26.4. Каждое обязательство по поставочному Фьючерсу с наступившей Датой исполнения, базовым активом которых является Товар, не включенное в клиринговый пул по итогам его формирования, является неисполненным и прекращается.

- 26.5. В случае неисполнения Участниками срочного рынка обязательств по поставке предусмотренных Спецификацией, Участник срочного рынка, признанный недобросовестной стороной выплачивает штраф в качестве отступного в порядке и на условиях, предусмотренных Спецификацией Фьючерса.

- 26.5.1. Обязательство по перечислению штрафа учитывается на разделе денежного регистра в порядке, установленном статьей 10 Правил клиринга для учета обязательств по перечислению денежных средств.

Данное обязательство учитывается на разделе денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались прекращенные выплатой отступного обязательства по поставочному Фьючерсу.

Статья 27. Порядок оплаты клиринговых услуг, услуг по организации торговли, уплаты штрафов

- 27.1. Перечень услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам срочного рынка (далее – клиринговые услуги), и размер платы за клиринговые услуги устанавливаются решением Клирингового центра и являются приложением № 10 к Правилам клиринга.

- 27.2. В соответствии с договором, заключенным Биржей с Клиринговым центром, Биржа уступает Клиринговому центру все права требования уплаты в соответствии с тарифами Биржи биржевого сбора за регистрацию Срочных контрактов, которые возникают у Биржи к Участникам срочного рынка при заключении ими Срочных контрактов на Бирже.
- 27.3. Обязательства по оплате клиринговых услуг, обязательства по уплате биржевого сбора за регистрацию Срочных контрактов, обязательства по уплате штрафов, установленных Правилами клиринга, учитываются Клиринговым центром на разделах денежного регистра в ходе дневной и вечерней клиринговой сессии в порядке, установленном статьей 10 Правил клиринга для учета обязательств по перечислению денежных средств.
- Порядок выбора раздела денежного регистра, на котором учитываются обязательства по оплате клиринговых услуг и уплате штрафов, определен Правилами клиринга или приложением № 10 к Правилам клиринга.
- Обязательство по уплате биржевого сбора за регистрацию Срочных контрактов учитывается на разделе денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, указанного при заключении Срочного контракта.
- Прекращение всех указанных обязательств зачетом или исполнением осуществляется в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ III. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА)

ПОДРАЗДЕЛ III-1. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА) ПО СДЕЛКАМ, ЗАКЛЮЧЕННЫМ В РЕЖИМЕ ТОРГОВЛИ T+0 (T+N)

Статья 28. Общие положения

- 28.1. Исполнения обязательств по оплате / передаче Товара по Сделкам с товаром, осуществляются с использованием Торговых счетов, предварительно зарегистрированных в Клиринговом центре.
Обязательства по передаче Товара исполняются путем передачи права собственности на Товар по двойному складскому свидетельству.
- 28.2. Учет информации о количестве Товара ведется Клиринговым центром с использованием кода Товара. Учет информации о количестве двойных складских свидетельств ведется Клиринговым центром с использованием кода двойного складского свидетельства.
- 28.2.1. Клиринговый центр устанавливает однозначное соответствие кодов Товаров и кодов двойных складских свидетельств.
- 28.2.2. Количество Товара, право собственности на который удостоверяется двойным складским свидетельством, кратно Торговому лоту.
- 28.2.3. Пересчет количества Товара в количество двойных складских свидетельств и наоборот осуществляется Клиринговым центром с учетом Торгового лота, установленного для Товара.
- 28.3. Клиринговый центр получает от Расчетной организации информацию о количестве двойных свидетельств и суммах денежных средств, учитываемых на Торговых счетах.
- 28.4. Сделки с товаром заключаются на Торгах Биржи с указанием Кодов торговых счетов, предварительно зарегистрированных в Клиринговом центре. Код торговых счетов содержит указание на Торговые счета, с использованием которых должны проводиться расчеты по Сделкам с товаром.
- 28.5. Клиринг по Сделкам с товаром, за исключением Сделок с условием обратного выкупа и Сделок с отложенным исполнением, осуществляется на основании Реестров сделок, полученных Клиринговым центром от Биржи.
- 28.5.1. Клиринг по Сделкам с условием обратного выкупа и Сделкам с отложенным исполнением осуществляется на основании Поручений на клиринг в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 28.6. По итогам клиринга и исполнения обязательств по оплате / передаче Товара Клиринговый центр предоставляет Участникам клиринга отчеты.

Статья 29. Порядок регистрации Торговых счетов

- 29.1. Торговые счета должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре.
- 29.2. Основанием для регистрации Торговых счетов являются:
- Уведомление об открытии Торгового счета, полученное Клиринговым центром от Расчетной организации;
 - Заявление на регистрацию Торгового счета (по форме В01, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга), полученное Клиринговым центром от владельца счета.

- 29.2.1. Совместно с Заявлением на регистрацию Торгового счета владельцы Торговых счетов, не являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру следующие документы:
- а) нотариально заверенную копию учредительных документов юридического лица (включая дополнения и изменения, действующие на дату заключения договора) с отметкой о регистрации юридического лица органами юстиции;
 - б) нотариально заверенную копию свидетельства о государственной регистрации юридического лица;
 - в) нотариально заверенную копию свидетельства налогоплательщика Республики Казахстан;
 - г) нотариально заверенную копию свидетельства о постановке на учет по налогу на добавленную стоимость (НДС) (в случае наличия);
 - д) нотариально заверенную копию документа, подтверждающего избрание (назначение) лица, действующего от имени юридического лица без доверенности, или копию, заверенную печатью юридического лица;
 - е) нотариально заверенную копию карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица;
 - ж) доверенности на лиц, имеющих право подписи от имени юридического лица (в случае необходимости).
- 29.2.2. Клиринговый центр регистрирует Торговый счет в срок не позднее 3 (трех) Рабочих дней с даты получения всех необходимых документов.
- 29.3. Если иное не установлено договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией, Уведомление об открытии Торгового счета считается полученным Клиринговым центром с момента получения Клиринговым центром от Расчетной организации в процессе взаимодействия, описанного в статье 31 Правил, Реестра остатков на Торговых счетах, в который внесена запись о Торговом счете.
- 29.4. Передача Клиринговому центру полномочий на право получения информации о количестве двойных складских свидетельств или сумме денежных средств, учитываемых на Торговом счете, и на право подписывать и подавать в Расчетную организацию поручения на списание с Торгового счета и /или поручения на зачисление на Торговый счет двойных складских свидетельств или денежных средств осуществляется в соответствии с Законодательством и договором с Расчетной организацией.
- 29.5. В Заявлении на регистрацию Торгового счета должен быть указан Участник клиринга, который имеет право указывать данный Торговый счет при регистрации Кодов торговых счетов, и исполнять обязательства по Сделкам с товаром и Срочным контрактам за счет денежных средств (двойных складских свидетельств), учитываемых на данном Торговом счете.
- 29.5.1. Если Участник клиринга, который имеет право указывать Торговый счет при регистрации Кодов торговых счетов, является владельцем Торгового счета, то Заявление на регистрацию Торгового счета не предоставляется.
- 29.6. Клиринговый центр вправе аннулировать регистрацию Торгового счета:
- 1) на основании заявления лица, предоставившего Заявление на регистрацию Торгового счета;
 - 2) в случае закрытия Торгового счета Расчетной организацией;
 - 3) в случае прекращения полномочий Клирингового центра на право осуществления распорядительных действий по Торговому счету;
 - 4) в случае расторжения договора об осуществлении клирингового обслуживания с Участником клиринга, зарегистрировавшим Торговый счет;
 - д) в случае расторжения договора об осуществлении клирингового обслуживания с Участником клиринга, имеющим право указывать данный Торговый счет при регистрации Кодов торговых счетов, и исполнять обязательства по Сделкам с

товаром и Срочным контрактам за счет денежных средств (двойных складских свидетельств), учитываемых на данном Торговом счете;

- е) в случае получения Клиринговым центром от Биржи информации о расторжении договора об оказании услуг по организации торговли с участником торгов, являющимся Участником клиринга, имеющим право указывать данный Торговый счет при регистрации Кодов торговых счетов, и исполнять обязательства по Сделкам с товаром и Срочным контрактам за счет денежных средств (двойных складских свидетельств), учитываемых на данном Торговом счете.

29.6.1. Торговый счет, регистрация которого в Клиринговом центре аннулирована, не может использоваться при осуществлении клиринга Клиринговым центром.

Статья 30. Коды торговых счетов

- 30.1. Код торговых счетов устанавливает соответствие между Торговым счетом, предназначенным для учета двойных складских свидетельств, и Торговым счетом, предназначенным для учета суммы денежных средств, с использованием которых должны проводиться расчеты по Сделке с товаром, заключенной с указанием данного Кода торговых счетов.
- 30.2. Коды торговых счетов должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре. Информация о зарегистрированных Кодах торговых счетов передается Клиринговым центром Бирже перед началом Торгов.
- 30.3. Регистрация Кодов торговых счетов осуществляется на основании Заявления на регистрацию Кодов торговых счетов, предоставляемого Клиринговому центру Участником клиринга по форме С01, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 30.4. Торговые счета, указанные в Заявлении на регистрацию Кодов торговых счетов, должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре в порядке, определенном статьей 29 Правил клиринга.
- 30.5. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Кода торговых счетов в случае, если использование Торговых счетов, зарегистрированных в составе данного Кода торговых счетов при заключении Сделок с товаром и/или расчетах по Сделкам с товаром приведет к нарушению требований Законодательства и/или в случае и/или в случае несоблюдения требований Клирингового центра к правилам и порядку регистрации Кодов торговых счетов.
- 30.6. Клиринговый центр в срок не позднее 3 (трех) Рабочих дней с даты получения Заявления на регистрацию Кодов торговых счетов регистрирует Код торговых счетов либо направляет Участнику клиринга, предоставившему Заявление, уведомление об отказе в регистрации Кода торговых счетов с указанием причины.
- 30.7. Клиринговый центр аннулирует регистрацию Кода торговых счетов по заявлению Участника клиринга, осуществившего регистрацию, а также в случае аннулирования регистрации хотя бы одного из Торговых счетов, входящего в состав данного Кода торговых счетов.

Статья 31. Порядок получения Клиринговым центром информации о количестве двойных складских свидетельств и сумме денежных средств, учитываемых на Торговых счетах

- 31.1. Клиринговый центр получает информацию о количестве двойных складских свидетельств и сумме денежных средств, учитываемых на Торговых счетах, от Расчетной организации в виде Реестра остатков на Торговых счетах.
Содержание и формат Реестров остатков на Торговых счетах определяется договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетной организацией.

- 31.2. Реестр остатков на Торговых счетах, получаемый Клиринговым центром от Расчетной организации с целью получения информации о количестве двойных складских свидетельств, учитываемых на Торговых счетах, содержит следующие реквизиты:
- номер Торгового счета;
 - код двойного складского свидетельства;
 - количество двойных складских свидетельств с данным кодом на Торговом счете.
- 31.3. Реестр остатков на Торговых счетах, получаемый Клиринговым центром от Расчетной организации с целью получения информации о суммах денежных средств, учитываемых на Торговых счетах, содержит следующие реквизиты:
- номер Торгового счета;
 - код валюты;
 - сумму денежных средств на Торговом счете.
- Код валюты принимает значение "KZT" для казахстанских тенге.

Статья 32. Порядок взаимодействия с Биржей в процессе объявления заявок / заключения Сделок с полным обеспечением

- 32.1. При подаче участником торгов Заявки с целью заключения Сделки с полным обеспечением Биржа направляет Клиринговому центру информацию о поданной Заявке.
- 32.2. При получении от Биржи информации о Заявке, поданной с целью заключения Сделки с полным обеспечением, Клиринговый центр немедленно проверяет, что заключение Сделки с полным обеспечением на основании данной Заявки не приведет к невозможности формирования в порядке, установленном Правилами клиринга, поручений на проведение расчетов по Сделкам с товарам и поставочным Фьючерсам, базовым активом которых является Товар, в пределах сумм денежных средств и количества двойных складских свидетельств, учитываемых на Торговых счетах по информации, полученной от Расчетной организации.
- 32.3. В случае положительного результата проверки, указанной в пункте 32.2 настоящей статьи, Клиринговый центр направляет Бирже подтверждение возможности объявления Заявки, в случае отрицательного результата - отказ в объявлении Заявки.

Статья 33. Порядок получения от Биржи информации о заключенных Сделках с товаром

- 33.1. При осуществлении клиринга Клиринговый центр использует информацию о Сделках с товаром, получаемую от Биржи.
Данная информация передается Биржей в виде Реестра сделок.
- 33.2. Реестр сделок передается Биржей сразу после окончания Торгов в Режиме торговли с расчетами T+0 и содержит информацию о Сделках с товаром, заключенных в Режиме торговли с расчетами T+0 в течение текущего Торгового дня.

Статья 34. Поручения на клиринг

- 34.1. Для проведения расчетов по Сделкам с условием обратного выкупа и Сделкам с отложенным исполнением, заключенным на Торгах Биржи, Участники клиринга направляют Клиринговому центру Поручения на клиринг.
- 34.1.1. Поручение на клиринг для расчетов по Сделке с отложенным исполнением, а также Поручения на клиринг во исполнение Первой части сделки и Второй части сделки с условием обратного выкупа подается в электронном виде с использованием

Торговой системы Биржи как единый электронный документ, подтвержденный обоими Участниками клиринга.

- 34.2. Клиринговый центр вправе отказать в приеме Поручения на клиринг в случае, если его исполнение приведет к нарушению требований Законодательства, в случае несоблюдения требований Клирингового центра к правилам и порядку оформления и подачи Поручений на клиринг и в случае, если исполнение Поручения на клиринг приведет к невозможности формирования в порядке, установленном Правилами клиринга, поручений на проведение расчетов по Сделкам с товарам и поставочным Фьючерсам, базовым активом которых является Товар, в пределах сумм денежных средств и количества двойных складских свидетельств, учитываемых на Торговых счетах по информации, полученной от Расчетной организации
- 34.3. Поручение на клиринг по Сделке с отложенным исполнением, а также Поручения на клиринг во исполнение Первой части сделки и Второй части сделки с условием обратного выкупа исполняются только в дату подачи соответствующего поручения.
- 34.4. Поручения на клиринг по Сделкам с отложенным исполнением и Поручения на клиринг во исполнение Первых частей сделки и Вторых частей сделки с условием обратного выкупа отмене не подлежат.

Статья 35. Порядок проведения Клиринговых сессий

- 35.1. Исполнение обязательств по Сделкам с товаром, осуществляется в ходе расчетной Клиринговой сессии.
- 35.1.1. Расчетная Клиринговая сессия проводится Клиринговым центром сразу после окончания Торгов в Режиме торговли с расчетами T+0 Биржи.
- 35.2. Обязательства, включенные в клиринговый пул, прекращаются (исполнением, зачетом) в ходе проведения расчетной Клиринговой сессии.
- 35.3. В ходе расчетной Клиринговой сессии Клиринговый центр:
1. включает в клиринговый пул обязательства по Сделкам с товаром;
 2. определяет обязательства, подлежащие исполнению в рамках данной расчетной Клиринговой сессии;
 1. формирует поручения¹ на проведение операций по Торговым счетам с целью проведения расчетов по подлежащим исполнению обязательствам и осуществляет взаимодействие с Расчетной организацией с целью исполнения сформированных поручений.

Статья 36. Порядок включения в клиринговый пул и определения подлежащих исполнению обязательств по Сделкам с товаром

- 36.1. Клиринговый центр включает в клиринговый пул обязательства по следующим Сделкам с товаром:
- Сделкам с полным обеспечением, информация о которых содержится в Реестре сделок, полученном от Биржи в текущий Торговый день;
 - Первым частям сделок, Вторым частям сделок с условием обратного выкупа и Сделкам с отложенным исполнением, Поручения на клиринг во исполнение которых были поданы в текущий Торговый день.
- 36.2. Каждое включенное в клиринговый пул обязательство по Сделкам с товаром является подлежащим исполнению в рамках расчетной Клиринговой сессии.

¹ Под поручениями на проведение операций по Торговым счетам в целях настоящего документа здесь и далее по тексту понимаются как собственно поручения на проведение операций по Торговым счетам, а также иные документы, на основании которых Расчетная организация осуществляет расчеты по Сделкам с товаром и Срочным контрактам в соответствии с ее нормативными документами.

Статья 37. Проведение расчетов по сделкам Расчетной организацией

- 37.1. Клиринговый центр передает в Расчетную организацию поручения на проведение расчетов по сделкам с целью исполнения обязательств по передаче и оплате Товара в виде Реестров поручений на проведение расчетов по сделкам в формате, определяемом договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией.
- 37.2. После получения от Клирингового центра Реестров поручений на проведение расчетов по сделкам Расчетная организация проверяет возможность проведения расчетов в соответствии с каждым из полученных реестров и направляет Клиринговому центру сообщения о возможности или невозможности проведения расчетов.
- 37.3. Если Расчетная организация сообщила Клиринговому центру о возможности проведения расчетов в соответствии с Реестрами поручений на проведение расчетов по сделкам, Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на исполнение расчетов.
В момент отправки Клиринговым центром Расчетной организации распоряжения на исполнение расчетов включенные в клиринговый пул обязательства, на основании которых в соответствии со статьей 36 Правил клиринга были сформированы и направлены в Расчетную организацию поручения на проведение расчетов по сделкам, считаются исполненными.
- 37.4. После получения от Клирингового центра распоряжений на исполнение расчетов Расчетная организация исполняет поручения из полученных от Клирингового центра Реестров поручений на проведение расчетов по сделкам, и направляет Клиринговому центру подтверждения исполнения расчетов.
- 37.5. Если Расчетная организация сообщила Клиринговому центру о невозможности исполнения хотя бы одного Реестра поручений на проведение расчетов по сделкам, Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжения на отмену расчетов, в ответ на которые Расчетная организация направляет Клиринговому центру подтверждения отмены расчетов.
- 37.5.1. В случае отправки распоряжений на отмену расчетов Клиринговый центр совместно с Расчетной организацией предпринимает меры по скорейшему выяснению причин возникновения ошибки и устранению ее последствий.

Статья 38. Отчеты Клирингового центра

- 38.1. По итогам каждого Рабочего дня Клиринговый центр формирует и направляет каждому Участнику клиринга отчеты.
Спецификация форматов отчетов определена приложением № 3 к Правилам клиринга.
Отчеты предоставляются в электронном виде.
- 38.2. Отчеты могут быть предоставлены на бумажном носителе Участнику клиринга по его запросу в течение 3 (трех) Рабочих дней после получения запроса.
- 38.3. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты. При этом действительным считается последний направленный отчет.

Статья 39. Порядок оплаты клиринговых услуг

- 39.1. Оплата услуг Клирингового центра за клиринг Сделок с товаром, заключенных в Режиме торговли с расчетами Т+0 Биржи, в соответствии с Тарифами Клирингового центра, являющимися приложением № 10 к Правилам клиринга, производится на основании счетов, выставяемых Клиринговым центром по итогам каждого календарного месяца.

Счета выставляются не позднее 10 (десятого) числа следующего календарного месяца.

Услуги должны быть оплачены до конца месяца, следующего за оплачиваемым.

ПОДРАЗДЕЛ III-II. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОПЛАТЕ / ПЕРЕДАЧЕ ТОВАРА (ЗЕРНА) ПО ПОСТАВОЧНЫМ ФЬЮЧЕРСАМ.

Статья 40. Порядок исполнения поставочных Фьючерсов.

- 40.1. За две недели до последнего дня заключения поставочного фьючерса Клиринговый центр направляет Участникам клиринга отчет, содержащий уведомление о приближении срока исполнения.
- 40.2. Исполнение поставочного фьючерса осуществляется в соответствии с требованиями, установленными Спецификацией контракта.
- 40.3. Спецификацией контракта может быть предусмотрено, что передача товара осуществляется поставочными партиями. Величина поставочной партии, которая может быть равной одному или нескольким лотам (Фьючерсам), а также пределы отклонения от установленной величины поставочной партии при исполнении обязательства по поставке определяется Решением Биржи. Если Решением Биржи поставочная партия определена как величина равная нескольким лотам (Фьючерсам), то обязательство по поставке по такому фьючерсу может быть исполнено только при одновременном исполнении обязательства по Фьючерсам вместе составляющим поставочную партию.
- 40.4. В случае если за ненадлежащее исполнение или неисполнение поставочного фьючерса Спецификацией фьючерса установлен штраф (пени), для исполнения обязательства по уплате штрафа (пени) Клиринговый центр изменяет (увеличивает или уменьшает) значение раздела денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по поставочному фьючерсу.

РАЗДЕЛ IV. Дополнительные гарантии в Режиме классической биржевой торговли

ПОДРАЗДЕЛ IV-I. Специализированный биржевой аукцион

Статья 41. Гарантийное обеспечение

- 41.1. Гарантийное обеспечение - денежные средства, переданные Участником Аукциона в Клиринговый центр в качестве гарантии его участия в Аукционе и исполнения обязательств в случае победы в Аукционе.
- 41.2. Размер Гарантийного обеспечения для каждого Аукциона определяется Заказчиком и указывается в Заявке на проведение Аукциона.
- 41.3. Участники Аукциона, не внесшие Гарантийное обеспечение в установленные Статьей 42 сроки, лишаются статуса Участника Аукциона.

Статья 42. Внесение гарантийного обеспечения

- 42.1. Гарантийное обеспечение в целях участия в конкретном Аукционе вносится Брокером с момента присвоения ему статуса Участника Аукциона.
- 42.2. Гарантийное обеспечение вносится исключительно деньгами в валюте Республики Казахстан на банковский счет Клирингового центра.
В качестве назначения платежа необходимо указать «**Гарантийное обеспечение для участия в Аукционе № _____ (номер Аукциона в объявлении о проведении Аукциона). Клиент № _____ . НДС не облагается .»**
- 42.3. Если у Участника Аукциона на счете в Клиринговом центре имеется достаточное количество свободных денежных средств, не предназначенных для оплаты Товаров, то Гарантийное обеспечение удерживается из этих средств.
- 42.4. Денежные средства гарантийного обеспечения подлежат зачислению на банковский счет Клирингового центра не позднее 17:00 рабочего дня, предшествующего дню проведения Аукциона. Участник Аукциона, не выполнивший данное требование, лишается своего статуса в отношении соответствующего клиента.
- 42.5. Гарантийное обеспечение блокируется в течение всего времени проведения Аукциона.

Статья 43. Возврат гарантийного обеспечения

- 43.1. Гарантийное обеспечение возвращается Участникам Аукциона, за исключением Победителя Аукциона, не позднее рабочего дня следующего за днем проведения Аукциона без дополнительного предоставления Участниками Аукциона Заявления на возврат денег. Возврат проводится на зарегистрированный счет для возврата денежных средств Участника Аукциона.
 - 43.1.1. Участник Аукциона может подать заявление о присоединении средств Гарантийного обеспечения к иным средствам, используемым Участником Аукциона для иных операций на Бирже, в том числе и для участия в других Аукционах.
- 43.2. Гарантийное обеспечение возвращается Победителю аукциона не позднее рабочего дня следующего за днем исполнения Победителем аукциона обязательств по предоставлению Бирже Отчета об оформлении Сделки. Возврат проводится без предоставления Победителем Аукциона Заявления на возврат денежных средств на зарегистрированный счет Победителем Аукциона.
 - 43.2.1. Победитель Аукциона может подать заявление о присоединении средств Гарантийного обеспечения к иным средствам, используемым Победителем

Аукциона для операций на Бирже (не связанными с оплатой Товара), в том числе и для участия в других Аукционах.