

ПОЛОЖЕНИЕ О СТРАХОВОМ И РЕЗЕРВНОМ ФОНДАХ

Статья 1. Общие положения

- 1.1. В рамках системы мер снижения рисков неисполнения Срочных контрактов Клиринговый центр создает Страховой и Резервный фонды.
- 1.2. Средства Страхового и Резервного фондов учитываются на отдельных счетах на балансе Клирингового центра.
- 1.3. Информация о текущем размере Страхового и Резервного фондов публикуется в сети Интернет по адресу <http://www.ets.kz>.

Статья 2. Порядок формирования Резервного фонда

- 2.1. Резервный фонд формируется только из денежных средств Клирингового центра.
- 2.2. Источником формирования Резервного фонда является прибыль Клирингового центра.
- 2.3. Размер Резервного фонда и порядок отчислений в Резервный фонд устанавливаются Клиринговым центром.

Статья 3. Порядок формирования Страхового фонда

- 3.1. Страховой фонд формируется из взносов Участников срочного рынка.
- 3.2. Размер Взноса в Страховой фонд устанавливается и изменяется Клиринговым центром.
- 3.3. В случае принятия решения об увеличении размера Взноса в Страховой фонд Клиринговый центр направляет Участникам срочного рынка уведомление, содержащее требование о доведении средств в Страховой фонд. Указанное уведомление направляется Клиринговым центром в срок не позднее, чем за 15 (пятнадцать) дней до установленной решением даты увеличения размера Взноса в Страховой фонд.
- 3.4. В случае невыполнения Участником клиринга требования о доведении средств в Страховой фонд до величины установленного размера Взноса в Страховой фонд в установленный срок Клиринговый центр вправе:
 - изменить учет обязательств по перечислению денежных средств на основном разделе денежного регистра, открытого для учета обязательств по перечислению денежных средств, возникающих между Клиринговым центром и Участником срочного рынка, и разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд. Указанное изменение осуществляется в порядке, определенном в статье 4 настоящего положения;
 - направить Бирже уведомление о необходимости приостановки доступа Участника срочного рынка к Торгам в Режиме торговли на срочном рынке.

Статья 4. Порядок внесения Взносов в Страховой фонд

- 4.1. Внесение Взноса в Страховой фонд для регистрации Клиринговым центром Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка и доведение средств в

Страховой фонд в соответствии с требованием Клирингового центра, указанным в пунктах 3.3 и 7.6 настоящего положения, возможно двумя способами:

- 1) путем перечисления денежных средств на счет Клирингового центра в казахстанских тенге, открытый в Расчетной организации;
- 2) путем изменения учета обязательств по перечислению денежных средств на разделе денежного регистра и разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд.

4.2. Реквизиты счета Клирингового центра для перечисления денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд, публикуются на сайте в сети Интернет по адресу <http://www.ets.kz>.

4.3. При перечислении денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд Участника срочного рынка, на счет Клирингового центра должно быть указано назначение платежа, однозначно определяющее данные средства, как Взнос в Страховой фонд, и содержащее номер и дату договора об осуществлении клирингового обслуживания, заключенного между Участником срочного рынка и Клиринговым центром.

Пример назначения платежа: «Перечисление Взноса в Страховой фонд по договору №5-К от 15.10.2009. НДС не облагается».

4.4. При перечислении денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонда Участника срочного рынка, на счет Клирингового центра у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику срочного рынка денежные средства, составляющие его Взнос в Страховой фонд.

Указанное обязательство учитывается Клиринговым центром в порядке, определенном статьей 11 Правил клиринга, на разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, открытом для учета обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд Участника срочного рынка, номер и дата договора об осуществлении клирингового обслуживания заключенного с которым указаны в назначении платежа в поручении на перевод денежных средств.

4.5. Для изменения учета обязательств по перечислению денежных средств на разделе денежного регистра и разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд Участник срочного рынка вправе подать в Клиринговый центр Заявление на перевод денежных средств в Страховой фонд по форме G05, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга.

4.6. Изменение учета обязательств по перечислению денежных средств на разделе денежного регистра и разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд осуществляется Клиринговым центром при выполнении условий, необходимых для перечисления денежных средств со счета Клирингового центра, определенных приложением № 9 к Правилам клиринга.

4.7. При изменении учета обязательств по перечислению денежных средств на разделе денежного регистра и разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд обязательства по перечислению денежных средств снимаются Клиринговым центром с учета с раздела денежного регистра и ставятся на учет на раздел регистра учета Взносов в Страховой фонд.

Статья 5. Порядок возврата Взносов в Страховой фонд Участникам срочного рынка

5.1. Возврат Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих его Взнос в Страховой фонд, осуществляется Клиринговым центром на основании предоставленного Участником срочного рынка в Клиринговый центр Заявления на возврат Взноса в Страховой фонд по форме G04, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга.

- 5.2. В Заявлении на возврат Взноса в Страховой фонд должны быть указаны реквизиты банковского счета Участника срочного рынка, на который должны быть перечислены денежные средства.
Указанный счет должен быть предварительно зарегистрирован в Клиринговом центре в порядке, определенном приложением № 9 к Правилам клиринга для регистрации счета для возврата денежных средств.
- 5.3. Заявление на возврат Взноса в Страховой фонд исполняется Клиринговым центром в случае, если у Участника срочного рынка отсутствует общая дебиторская задолженность перед Клиринговым центром и неисполненное Маржинальное требование, и исполнение заявления не приведет к тому, что фактический размер Взноса Участника срочного рынка в Страховой фонд станет меньше, чем установленный размер Взноса в Страховой фонд.
Порядок выставления Маржинальных требований Участнику срочного рынка и порядок определения наличия общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка установлен Правилами клиринга.
- 5.4. В случае принятия Клиринговым центром решения об аннулировании регистрации Участника клиринга в качестве Участника срочного рынка возврат денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд, осуществляется, если у Участника срочного рынка отсутствует обязательства по Срочным контрактам.
В случае наличия обязательств Участника срочного рынка по Срочным контрактам Клиринговый центр вправе направить Бирже уведомление о приостановке доступа данного Участника срочного рынка к Торгам в Режиме торговли на срочном рынке и применить к Участнику срочного рынка процедуру принудительного закрытия позиций в порядке, установленном приложением № 11 к Правилам клиринга.
- 5.5. При возврате денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд Участника срочного рынка, Клиринговый центр уменьшает значение, учитываемое на соответствующем разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, и направляет в Расчетную организацию поручение на перевод денежных средств, сформированное на основании данного заявления.

Статья 6. Порядок использования Страхового и Резервного фондов

- 6.1. Страховой и Резервный фонды используются Клиринговым центром для компенсации риска потери Клиринговым центром ликвидности при исполнении Клиринговым центром обязательств по перечислению денежных средств Участникам срочного рынка (погашению кредиторской задолженности), вызванного наличием общей дебиторской задолженности одного или нескольких Участников срочного рынка перед Клиринговым центром.
- 6.2. В случае непогашения Участником срочного рынка общей дебиторской задолженности в срок, установленный Правилами клиринга, Клиринговый центр осуществляет зачет обязательств по перечислению денежных средств, составляющих общую дебиторскую задолженность Участника срочного рынка перед Клиринговым центром, с обязательством Клирингового центра по возврату Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд данного Участника срочного рынка.
- 6.2.1. Зачет осуществляется на сумму, равную минимальному из двух значений: объема общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка и объема обязательства Клирингового центра по возврату Участнику срочного рынка денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд данного Участника срочного рынка.
- 6.2.2. В результате такого зачета значения, учитываемые на разделах денежного регистра, открытых для учета обязательств по перечислению денежных средств, возникающих между Клиринговым центром и Участником срочного рынка, имеющим общую дебиторскую задолженность, увеличиваются, а значение, учитываемое на соответствующем разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, уменьшается на объем обязательств, прекращенных зачетом.

- 6.3. Если по итогам зачета, указанного в пункте 6.2 настоящей статьи, общая дебиторская задолженность Участника срочного рынка полностью не погашена, Клиринговый центр использует средства Резервного фонда.
- 6.3.1. Использование средств Резервного фонда состоит в том, что Клиринговый центр резервирует все или часть средств данного фонда на компенсацию риска потери Клиринговым центром ликвидности.
- 6.3.2. При использовании средств Резервного фонда объем свободных средств Резервного фонда уменьшается на сумму зарезервированных денежных средств.
- 6.3.3. Сумма зарезервированных денежных средств определяется как минимальная из двух величин: свободных средства Резервного фонда и объема непогашенной общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка.
- 6.4. Если объем непогашенной общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка превышает свободные средства Резервного фонда, то Клиринговый центр компенсирует оставшийся риск потери Клиринговым центром ликвидности за счет использования денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд остальных Участников срочного рынка.
- 6.4.1. Использование денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд остальных Участников срочного рынка, осуществляется в равных объемах.
- 6.4.2. Использование денежных средств, составляющих Взносы в Страховой фонд Участников срочного рынка, заключается в безвозмездном получении Клиринговым центром указанных денежных средств от Участников срочного рынка для целей компенсации риска потери Клиринговым центром ликвидности.
- 6.4.3. При использовании денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд Участника срочного рынка, значение, учитываемое на соответствующем разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, уменьшается на сумму использованных денежных средств.
- 6.4.4. Клиринговый центр уведомляет Участников срочного рынка об использовании денежных средств, составляющих их Взносы в Страховой фонд, и об объеме использованных денежных средств.

Статья 7. Порядок возмещения Страхового и Резервного фондов

- 7.1. Если после использования средств Страхового и/или Резервного фондов, вызванного наличием общей дебиторской задолженности Участника срочного рынка, указанная общая дебиторская задолженность гасится Участником срочного рынка - должником, то Клиринговый центр возмещает средств данных фондов в порядке, обратном их использованию.
- 7.2. Сначала возмещаются Взносы в Страховой фонд других Участников срочного рынка.
- 7.2.1. Возмещение Взноса в Страховой фонд Участника срочного рынка заключается в безвозмездной передаче Клиринговым центром Участнику срочного рынка денежных средств, ранее полученных от него при использовании денежных средств, составляющих Взнос в Страховой фонд этого Участника срочного рынка.
- 7.2.2. При возмещении Взноса в Страховой фонд Участника срочного рынка значение, учитываемое на соответствующем разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, увеличивается на сумму возмещения.
- 7.2.3. Если общая дебиторская задолженность была погашена Участником срочного рынка не в полном объеме, то возмещение Взносов остальных Участников срочного рынка производится в равных объемах.
- 7.3. Затем возмещаются средства Резервного фонда.
- 7.3.1. При возмещении средств Резервного фонда объем свободных средств Резервного фонда увеличивается на сумму возмещения.

- 7.4. В последнюю очередь возмещается Взнос в Страховой фонд Участника срочного рынка - должника. При этом значение, учитываемое на соответствующем разделе регистра учета Взносов в Страховой фонд, увеличивается на сумму возмещения.
- 7.5. Если после использования Клиринговым центром средств Резервного фонда общая дебиторская задолженность Участника срочного рынка признается Клиринговым центром сомнительным требованием в соответствии с Законодательством, Клиринговый центр устанавливает равными нулю значения, учитываемые на разделах денежного регистра, открытого для учета обязательств по перечислению денежных средств, возникающих между Клиринговым центром и Участником срочного рынка, имевшим общую дебиторскую задолженность.
- 7.6. Если в течение 3 (трех) Рабочих дней с даты использования Взносов в Страховой фонд других Участников срочного рынка общая дебиторская задолженность не была погашена Участником срочного рынка – должником, то Клиринговый центр направляет Участникам срочного рынка, чей фактический размер Взноса в Страховой фонд стал меньше установленного размера взноса в Страховой фонд, уведомление, содержащее требование о доведении средств в Страховой фонд.
- 7.6.1. Участники срочного рынка обязаны в течение 3 (трех) Рабочих дней с даты получения уведомления, указанного в пункте 7.6 настоящей статьи, довести средства в Страховой фонд до установленного Клиринговым центром размера Взноса в Страховой фонд. Порядок доведения средства в Страховой фонд определяется статьями 3 и 4 настоящего положения.