

**РЕГЛАМЕНТ
ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
INTERNATIONAL TRADING SYSTEM LIMITED**

Астана, 2024 г.

ОГЛАВЛЕНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	3
Статья 1. Общие положения	3
РАЗДЕЛ II. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В ПРОЦЕССЕ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ	3
Статья 2. Особенности открытия Торговых счетов депо,	3
а также проведения операций по Торговым счетам депо	3
Статья 3. Зачисление / возврат / перевод Средств обеспечения и зачисление / возврат Гарантийного фонда	4
Статья 4. Формы/форматы документов, используемых при взаимодействии КЦ	5
и Участника клиринга при осуществлении клиринга и взаимодействии с Расчетным депозитарием	5
Статья 5. Клиринговые отчеты и уведомления КЦ	7
Статья 6. Перечни ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС	8
Статья 7. Использование информации	8
Приложение 1	9
Приложение 2	12
Приложение 3	30
Приложение 4	51
Приложение 5	61

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Общие положения

1.1. Настоящий Регламент осуществления клиринговой деятельности International Trading System Limited (далее – Регламент клиринга) разработан в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности International Trading System Limited (далее – Правила клиринга) и Правилами допуска International Trading System Limited (далее - Правила допуска).

1.2. Регламент клиринга устанавливает расписание операционного дня International Trading System Limited (далее – КЦ) (включая время проведения операций, осуществляемых в соответствии с Правилами клиринга), сроки подачи в КЦ и получения от КЦ документов в процессе взаимодействия с Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга, формы / форматы документов, используемых в документообороте между Участниками клиринга и КЦ, а также иные положения, за исключением тех положений, которые должны содержаться в Правилах клиринга.

1.3. КЦ вправе в одностороннем порядке вносить изменения в Регламент клиринга. Раскрытие информации о внесении изменений в Регламент клиринга, в том числе о принятии Регламента клиринга в новой редакции, осуществляется путем размещения указанных изменений или новой редакции на Сайте КЦ. Регламент клиринга и вносимые в него изменения вступают в силу после раскрытия информации об этом в дату, определяемую КЦ.

1.4. Термины и определения, используемые в настоящем Регламенте клиринга, применяются в значениях, установленных Правилами клиринга.

РАЗДЕЛ II. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В ПРОЦЕССЕ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ

Статья 2. Особенности открытия Торговых счетов депо, а также проведения операций по Торговым счетам депо

2.1. Для открытия Торгового счета депо в Расчетном депозитарии лицу, на имя которого открывается Торговый счет депо, либо его уполномоченному представителю необходимо предоставить в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий заявление об открытии Торгового счета депо по форме, установленной документами Расчетного депозитария (далее – Заявление). В случае предоставления Заявления в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий в виде электронного документа необходимо предоставить также сопроводительное письмо в свободной форме, содержащее просьбу передать Заявление в Расчетный депозитарий.

2.2. Перечень документов, предоставляемых лицом, которому открывается Торговый счет депо, либо его уполномоченным представителем в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий для открытия Торгового счета депо указан в документах Расчетного депозитария. КЦ вправе потребовать также представления иных дополнительных документов (информации).

2.3. Для открытия второго и последующих Торговых счетов депо в Расчетном депозитарии, при условии наличия действующего Торгового счета депо в Расчетном депозитарии, предоставление документов, указанных в п.2.2, не требуется при условии, что такие документы не были изменены, в данных анкеты лица, которому открывается счет депо, не произошли изменения или срок анкеты не истек.

Для открытия второго и последующих Торговых счетов депо в Расчетном депозитарии, при условии наличия действующего Торгового счета депо в Расчетном депозитарии, Заявление может быть предоставлено в формате PDF лицом, которому открывается Торговый счет депо, либо его уполномоченным представителем по Системе электронного документооборота в виде Электронного документа, подписанного электронной подписью. При этом указанное в настоящем пункте Заявление должно быть подписано уполномоченным лицом. В случае предоставления указанного в настоящем пункте Заявления по Системе Электронного документооборота, Участник клиринга обязан предоставить в КЦ это Заявление на бумажном носителе для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий в течение 30 рабочих дней со дня его направления по Системе электронного документооборота.

2.4. Для закрытия Торгового счета депо в Расчетном депозитарии лицу, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченному представителю необходимо предоставить в КЦ заявление о закрытии Торгового счета депо по форме, установленной документами Расчетного депозитария.

Заявление о закрытии Торгового счета депо может быть предоставлено в формате PDF лицом, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченным представителем по Системе электронного документооборота в виде Электронного документа, подписанного электронной подписью или в оригинале. В случае предоставления указанного в настоящем пункте заявления по Системе Электронного документооборота, Участник клиринга обязан предоставить в КЦ это заявление на бумажном носителе для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий в течение 30 рабочих дней со дня его направления по Системе электронного документооборота.

2.5. Зачисление / списание ценных бумаг на / с Торговый счет (а) депо осуществляется посредством перевода ценных бумаг на / со счет (а) депо номинального держателя, открытый (ого) Расчетному депозитарию, по реквизитам, опубликованным на Сайте КЦ.

2.6. Для зачисления / списания ценных бумаг на / с Торгового (ых) счета (ов) депо, открытые (ых) Расчетным депозитарием, со / на счетов (а) депо, открытых (ые) в другом депозитарии, или с / на лицевых (ые) счетов (а) в системе реестров держателей ценных бумаг лица, которым открыты Торговые счета депо, либо их уполномоченные представители должны подать в КЦ поручения на внешнее зачисление / списание ценных бумаг в виде Электронных документов в формате XML, подписанных Электронной подписью, либо в виде документов на бумажном носителе, которые должны соответствовать PP61B.xsd схеме при зачислении и списании ценных бумаг. Формы / форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением 4 к Регламенту клиринга. Указанные в настоящем пункте поручения могут быть переданы в КЦ не ранее рабочего дня, следующего за днем открытия Торгового счета депо Расчетным депозитарием. При подаче поручений в дату открытия Расчетным депозитарием Торгового счета депо КЦ направляет Участнику клиринга в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью по Системе электронного документооборота, мотивированный отказ от исполнения поручения (сообщение MT596.SWF) по форме, определенной Приложением 4 к Регламенту клиринга.

2.7. Для совершения операций по переводу ценных бумаг между Торговыми счетами депо / разделами Торговых счетов депо, открытыми Расчетным депозитарием, лица, которым открыты Торговые счета депо, либо их уполномоченные представители должны подавать поручения в КЦ на перевод ценных бумаг в виде Электронных документов в формате XML, подписанных Электронной подписью, либо в виде документов на бумажном носителе, которые должны соответствовать PP61B.xsd схеме. Формы / форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением 4 к Регламенту клиринга.

2.8. Для отмены поручений лица, которым открыты Торговые счета депо, либо их уполномоченные представители должны подавать поручение на отмену операции в КЦ в виде Электронного документа в формате XML, подписанного Электронной подписью, либо в виде документа на бумажном носителе, который должен соответствовать PP61B.xsd схеме. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением 4 к Регламенту клиринга.

2.9. Поручения, указанные в пунктах 2.1.-2.8. настоящего Регламента клиринга в виде Электронных документов в формате XML, подписанных Электронной подписью, подаются в адрес КЦ «ITSCP@DEPO». Направление поручений, указанных в пунктах 2.1.-2.8. настоящего Регламента клиринга на бумажном носителе допускается в случае наличия технических неисправностей при работе Системы электронного документооборота и осуществляется с использованием службы курьерской доставки.

2.10. Для уведомления о статусе исполнения поручения или сообщения о мотивированном отказе КЦ отправляет инициатору операции сообщение MT596 в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, в формате, установленном Приложением 4 к Регламенту клиринга, с использованием адреса «ITSCP@DEPO».

2.11. При прекращении клирингового обслуживания Участника клиринга по инициативе КЦ вывод ценных бумаг, являющихся Средствам обеспечения Участника клиринга, осуществляется в дату прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга.

2.12. В случае направления Участником клиринга в КЦ распоряжения с целью изменения типа счета депо с Торгового счета депо на счет депо, КЦ с момента получения данного поручения прекращает принимать распоряжения Участника клиринга по данному Торговому счету депо. КЦ осуществляет списание находящихся на данном Торговом счете депо ценных бумаг, из Средств обеспечения и удаление ТКС, в состав которого входит данный Торговый счет депо. Удаление ТКС осуществляется при условии, что на ТКС нет открытых позиций и обязательств/требований по возвратам доходов по сделкам репо.

2.13. В случае удаления ТКС и/или расторжения договора на клиринговое обслуживание с Участником клиринга КЦ направляет в Расчетный Депозитарий письмо в свободной форме с целью изменения типа счета депо с Торгового счета депо на счет депо. Расчетный Депозитарий с момента получения данного распоряжения прекращает принимать от КЦ поручения на зачисление, списание, переводы ценных бумаг по данному Торговому счету депо. После изменения статуса Торгового счета все депозитарные поручения подаются в Расчетный Депозитарий напрямую, без участия ССР.

2.14. В случае проведения корпоративного события, в результате которого изменяется количество ценных бумаг, КЦ вправе отказать в приеме или обработке поручений на внешнее зачисление /списание указанных ценных бумаг по Торговым счетам депо, начиная с шестого рабочего дня, предшествующего дате закрытия реестра, в целях проведения корпоративного события.

Статья 3. Зачисление / возврат / перевод Средств обеспечения и зачисление / возврат Гарантийного фонда

3.1. Зачисление денежных средств в качестве Средств обеспечения и внесение денежных средств в Гарантийный фонд осуществляется путем перевода денежных средств на Клиринговые счета КЦ

по реквизитам, опубликованным на Сайте КЦ.

3.2. Денежные средства, указанные в п. 3.1. зачисляются на ТКС, указанный Участником клиринга в назначении платежа при осуществлении перевода денежных средств.

3.3. В случае указания в расчётных документах на перевод денежных средств неправильного или неполного назначения платежа, Участник клиринга может направить в КЦ письмо, подтверждающее соответствующее назначение платежа по Системе электронного документооборота. Указанное в настоящем абзаце письмо может быть направлено в КЦ банком, являющимся отправителем денежных средств по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа с использованием системы SWIFT.

3.4. Возврат денежных средств осуществляется путем подачи Участником клиринга в КЦ заявления на возврат денежных средств в виде Электронного документа «Сообщение CLAIM_WITHDRAW» по форме Приложения 3 к Регламенту клиринга, направляемого в адрес ITSCP@REGISTER.

3.5. Возврат денежных средств из Гарантийного фонда осуществляется путем подачи Участником клиринга в КЦ заявления на возврат денежных средств в виде Электронного документа сообщение «GUARANTEE_WITHDRAW» по форме, указанной в Приложении 3 к Регламенту клиринга, направляемого в адрес ITSCP@REGISTER. Не позднее следующего рабочего дня после подачи такого заявления КЦ приостанавливает допуск к Клиринговому обслуживанию Участника клиринга.

3.6. Перевод денежных средств между ТКС / разделами клиринговых регистров Участника клиринга осуществляется путем подачи Участником клиринга в КЦ заявления на перевод денежных средств между ТКС в виде Электронного документа «Сообщение TRANSFER_SETTLE» по форме Приложения 3 к Регламенту клиринга, направляемого в адрес ITSCP@REGISTER.

3.7. Для внесения ценных бумаг в Гарантийный фонд Участник клиринга обязан:

- Открыть Торговый счет со статусом «Гарантийный фонд ITS CCP» в Расчетном депозитарии (далее – Гарантийный счет).
- Направить в КЦ поручение на зачисление ценных бумаг на Гарантийный счет.

3.8. Выплаты по корпоративным событиям по ценным бумагам, учитываемым на Гарантийном счете, зачисляются на ТКС Гарантийного фонда независимо от того какой способ получения выплат был выбран Участником клиринга при открытии Гарантийного счета.

3.9. В случае корпоративного события по ценными бумагами, учитываемыми на Гарантийном счете, зачисление и/или списание ценных бумаг по результатам корпоративного события осуществляется на Гарантийный счет.

3.10. Участник клиринга обязан заменять облигации, учитываемые на Гарантийном счёте, иными ценными бумагами или денежными средствами не позднее, чем за 30 календарных дней до даты погашения этих облигаций. Ценные бумаги, учитываемые на Гарантийном счёте, не могут быть использованы для обеспечения и/или исполнения обязательств Участника клиринга по Контрактам, внебиржевым Контрактам и иным обязательствам, допущенным к клирингу.

Статья 4. Формы/форматы документов, используемых при взаимодействии КЦ и Участника клиринга при осуществлении клиринга и взаимодействии с Расчетным депозитарием

4.1. Формы / форматы документов приведены в Приложениях 3, 4 и 5 к Регламенту клиринга.

4.2. Документы, используемые при взаимодействии КЦ и Участников клиринга при осуществлении клиринга по Договорам Внебиржевым договорам, Внебиржевым договорам ОТС и взаимодействию с Расчетным депозитарием, предоставляются Участниками клиринга в КЦ в виде Электронных документов, подписанных Электронной подписью.

4.3. Для взаимодействия между КЦ и Участниками клиринга при осуществлении клиринга обязательств, возникших из Внебиржевых договоров ОТС, используются следующие документы:

5.3.1. Поручение на клиринг внебиржевых договоров для целей осуществления клиринга обязательств, возникших из Внебиржевых договоров ОТС (формируется и предоставляется Участниками клиринга в КЦ посредством Системы в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью), которое содержит следующую информацию:

- предмет Внебиржевого договора ОТС;
- дата и время подачи Поручения на клиринг внебиржевых договоров;
- Идентификатор Участника клиринга, подавшего поручение на клиринг внебиржевых договоров;
- Идентификатор Участника клиринга, являющегося контрагентом по Внебиржевому договору;
- направление Внебиржевого договора ОТС;
- ТКС;
- краткий код клиента Участника клиринга, если Внебиржевой договор ОТС был заключен за счет и по поручению клиента Участника клиринга;
- наличие / отсутствие проверки достаточности Доступных средств при приеме Поручения на

клиринг внебиржевых договоров;

- цена одной ценной бумаги / цена единицы валюты, являющейся предметом Внебиржевого договора ОТС (в отношении Договора купли-продажи);
- цена одной ценной бумаги / единицы валюты по первой части Внебиржевого договора репо ОТС / своп (в отношении Договора репо / своп);
- цена одной ценной бумаги/единицы валюты по второй части Внебиржевого договора репо ОТС / своп (в отношении Договора репо/своп);
- ставка репо / своп (в отношении Договора репо / своп);
- дата исполнения Внебиржевого договора ОТС (в отношении договора купли-продажи);
- дата исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС / своп (в отношении договора репо/своп);
- дата исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС / своп (в отношении договора репо / своп);
- валюта цены / сопряженная валюта Внебиржевого договора ОТС;
- количество ценных бумаг в лотах / валюты, являющейся предметом Внебиржевого договора ОТС;
- размер лота (для ценных бумаг);
- сумма Внебиржевого договора ОТС в валюте цены (в отношении договора купли-продажи);
- сумма первой части Внебиржевого договора репо ОТС/ своп в валюте цены (в отношении договора репо);
- сумма второй части Внебиржевого договора репо ОТС/ своп в валюте цены (в отношении договора репо);
- размер / порядок расчета штрафа за неисполнение обязательств по Внебиржевому договору ОТС;
- реквизиты денежного счета для исполнения обязательств по Внебиржевому договору (при необходимости), которые могут включать: наименование банка-получателя, номер корреспондентского счета, номер расчетного счета, валюта счета; SWIFT банка-получателя, SWIFT банка-корреспондента, счет получателя;

• реквизиты счета депо для исполнения обязательств по Внебиржевому договору ОТС (при необходимости), которые могут включать: наименование депозитария, номер счета депо получателя, номер раздела счета депо.

4.4. Оферта ОТС, направляемая для целей заключения Внебиржевых договоров ОТС и Пар внебиржевых договоров ОТС (формируется и предоставляется Участниками клиринга в КЦ посредством Системы в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью), содержит следующую информацию:

- Идентификационный код ценной бумаги, являющейся предметом Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- дата и время подачи Оферты ОТС;
- Идентификатор Участника клиринга, направившего Оферту ОТС;
- Идентификатор Участника клиринга, направление связанной Оферты ОТС которым является условием заключения Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС между КЦ и Участником клиринга, направившим Оферту ОТС;
- направление Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- ТКС/Аналитический ТКС;
- краткий код клиента Участника клиринга, если Внебиржевой договор ОТС или Пара внебиржевых договоров ОТС подлежит заключению за счет и по поручению клиента Участника клиринга;
- цена одной ценной бумаги, являющейся предметом Внебиржевого договора купли-продажи ОТС;
- цена одной ценной бумаги по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару внебиржевых договоров ОТС;
- Ставка репо;
- дата исполнения Внебиржевого договора купли-продажи ОТС;
- дата исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС или Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС;
- дата исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС или Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС;
- валюта цены Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- валюта расчетов Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- количество ценных бумаг в лоте;

- размер лота;
- сумма Внебиржевого договора купли-продажи ОТС в валюте цены;
- сумма репо Внебиржевого договора репо ОТС или сумма Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, в валюте цены;
- сумма второй части Внебиржевого договора репо ОТС или сумма Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, в валюте цены.

Статья 5. Клиринговые отчеты и уведомления КЦ

5.1. Ежедневно КЦ формирует и направляет Участникам клиринга следующие отчеты / уведомления / выписки:

- CLR06 Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг);
- CLR06C Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);
- CLR13 Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях;
- CLR14 Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности;
- CLR15 Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга обязательств по уплате сумм клирингового сборов до исполнения этих обязательств и/или в дату удержания этих сумм из Средств обеспечения Участника клиринга;
- CLR20 Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- CLR21 Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга: предоставляется ежедневно при наличии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного счета для вывода Средств обеспечения;
- CLR22 Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга задолженности по денежному регистру до ее погашения;
- CLR23 Отчет об обязательствах по договорам;
- CLR23C Уведомление об обязательствах по Договорам (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);
- CLR76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд;
- CLR82 Уведомление о присвоении Кодов / регистрации Кратких кодов клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга;
- CLR98 Отчет о глобальных операциях и об обязательствах / требованиях по передаче Дохода: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга обязательств по передаче Дохода до момента исполнения этих обязательств, а также с момента заключения Участником клиринга Договора, порядок исполнения обязательств по которому подлежит изменению в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг, конвертацией и (или) дроблением ценных бумаг, проводимой без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иных действия, влияющих на исполнение обязательств по Договору, до момента исполнения обязательств по данному Договору;
- CLR98A Уведомление о размере обязательств / требований по передаче Дохода: предоставляется единовременно при определении обязательств Участников клиринга по передаче Дохода;
- CLR99 Отчет об обеспечении.

5.2. Формы и форматы клиринговых отчетов, выписок и уведомлений установлены Приложением 5 к Регламенту клиринга.

5.3. Указанные в настоящей статье отчеты, выписки и уведомления направляются КЦ Участникам клиринга с использованием адреса «ITSCP@REPORT».

5.4. При невозможности направления КЦ отчетов выписок и уведомлений с использованием адреса, указанного в пункте 5.3 настоящего Регламента клиринга, КЦ использует адрес clearing@itsx.kz. В данном случае отчеты, выписки и уведомления направляются КЦ на адреса Участников клиринга, указанные в Заявлении на регистрацию в качестве Участника клиринга или в заявлении об изменении данных Участника клиринга, в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

5.5. Информационные сообщения и иные письма КЦ может направлять с адреса info@itsx.kz а также со следующих адресов Системы электронного документооборота: ITSCP@CLIENT, ITSCP@DEPO.

5.6. В случае проведения корпоративного события, в результате которого изменяется количество ценных бумаг, КЦ вправе изменить содержание поля Код ЦБ, указав идентификационный код ценной бумаги, полученной в результате корпоративного события, в отчете CLR99 «Отчет об обеспечении», начиная с шестого рабочего дня, предшествующего дате закрытия реестра в целях проведения

корпоративного события.

Статья 6. Перечень ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС

6.1. Участник клиринга вправе направлять Оферты ОТС в отношении ценных бумаг, включенных в перечень ценных бумаг, в зависимости от выбранного Участником клиринга тарифного плана.

6.2. Перечни ценных бумаг, в отношении которых Участником клиринга могут направляться Оферты ОТС, определяются КЦ и публикуются на Сайте КЦ.

Статья 7. Использование информации

7.1. В целях проведения идентификации Участников клиринга и исполнения действующих требований законодательства в сфере противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма в соответствии с Правилами МФЦА по противодействию отмыванию денег, финансированию терроризма и санкциям, КЦ вправе передавать аффилированным юридическим лицам, в числе которых Расчетный депозитарий, необходимые сведения, а также любые документы, включая персональные данные, полученные КЦ от Участника клиринга в объеме, необходимом такому юридическому лицу в соответствии с установленными этим юридическим лицом требованиями по исполнению законодательства и дальнейшего оказания услуг Участнику клиринга.