



Об утверждении Правил осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами

Утративший силу

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 февраля 2012 года № 58. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 11 апреля 2012 года № 7555. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 октября 2018 года № 254 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования)

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Национального Банка РК от 29.10.2018 № 254 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

В соответствии с Законом Республики Казахстан от 28 декабря 2011 года "О внесении изменений и дополнений в законодательные акты Республики Казахстан по вопросам регулирования банковской деятельности и финансовых организаций в части минимизации рисков" Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ**:

1. Утвердить прилагаемые Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами.

2. Настоящее постановление вводится в действие с 1 июля 2012 года и подлежит официальному опубликованию.

*Председатель
Национального Банка*

Г. Марченко

Утверждены
постановлением Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 24 февраля 2012 года № 58

Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами

1. Общие положения

Настоящие Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами (далее – Правила) разработаны в соответствии с Законом Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг" и

определяют условия и порядок осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами.

1. Для целей Правил используются следующие понятия:

1) расчетная организация – центральный депозитарий и (или) иная организация, осуществляющая организацию расчетов (платежей) по сделкам с финансовыми инструментами;

2) клиринг – процесс определения, проверки и передачи информации о требованиях и (или) обязательствах клиринговых участников торгов в результате совершения ими сделок с финансовыми инструментами;

3) клиринговая организация – организация, обладающая лицензией на клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами, и центральный депозитарий;

4) правила клиринговой организации – внутренние документы клиринговой организации, определяющие порядок взаимоотношения клиринговой организации с субъектами, пользующимися услугами клиринговой организации;

5) клиринговый участник торгов – юридическое лицо, заключившее договор об осуществлении клирингового обслуживания с клиринговой организацией, являющееся одним из следующих лиц:

членом фондовой и (или) товарной биржи;

клиентом котировочной организации внебиржевого рынка ценных бумаг;

лицом, подключенным к системе подтверждения фондовой биржи;

6) чистая позиция (нетто-позиция) - позиция клирингового участника торгов по каждой серии сделок с финансовыми инструментами, определяемая в результате взаимозачета требований и обязательств клирингового участника торгов и (или) его клиентов, возникших в результате сделок с данными финансовыми инструментами;

7) уполномоченный орган – уполномоченный орган по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций.

Сноска. Пункт 1 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования); с изменением, внесенным постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

2. Организационная структура клиринговой организации включает в себя подразделения, основными функциями которых являются:

1) осуществление клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами;

2) обработка и распространение информации;

3) программно-техническое обеспечение деятельности клиринговой организации;

4) управление рисками клиринговой организации;

5) мониторинг финансового состояния клиринговых участников торгов, а также их соответствия правилам клиринговой организации;

6) внутренний аудит и контроль.

3. Организатор торгов, совмещающий деятельность по организации торговли с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами с клиринговой деятельностью, или центральный депозитарий, совмещающий депозитарную деятельность с клиринговой деятельностью, обеспечивает наличие:

1) в организационной структуре отдельного (отдельных) подразделения (подразделений) для осуществления функций в рамках клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами;

2) у подразделения (подразделений), осуществляющего (осуществляющих) клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами, отдельных помещений, а также систем сбора, регистрации и учета информации для осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами, отдельных от систем, используемых подразделениями для осуществления других функций и видов профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

На подразделение (подразделения), осуществляющее (осуществляющие) клиринговую деятельность по сделкам с финансовыми инструментами, и работников данного подразделения не возлагаются функции подразделений организатора торгов или центрального депозитария, осуществляющих другие виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

Сноска. Пункт 3 с изменением, внесенным постановлением Правления Национального Банка РК от 27.05.2014 № 98 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

4. При совмещении организатором торгов деятельности по организации торговли ценными бумагами и иными финансовыми инструментами с клиринговой деятельностью, допускается совмещение функций подразделениями, указанными в подпунктах 2), 3), 4), 5) и 6) пункта 2 Правил, с подразделениями организатора торгов, осуществляющими аналогичные функции.

Сноска. Пункт 4 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

2. Клиринговые участники торгов

5. Для получения статуса клирингового участника торгов заявитель представляет заявление, составленное по форме, предусмотренной правилами клиринговой организации, и финансовую отчетность, составленную в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности, в порядке и сроки, предусмотренные правилами клиринговой организации, для осуществления клиринговой организацией мониторинга финансовой устойчивости клирингового участника торгов, а также соответствует следующим требованиям:

1) соблюдает пруденциальные нормативы по достаточности собственного капитала на дату получения статуса клирингового участника торгов и в течение трех месяцев, предшествующих такой дате (для финансовой организации – резидента Республики Казахстан);

2) соблюдает требования по достаточности собственного капитала, установленные правилами клиринговой организации (для юридического лица, не являющегося финансовой организацией – резидентом Республики Казахстан);

3) участвует в формировании специальных клиринговых (гарантийных) фондов по категориям рынков финансовых инструментов, к которым осуществляется допуск данного клирингового участника торгов и на которых клиринговая организация исполняет функции центрального контрагента;

4) открывает счета для учета финансовых инструментов в соответствии с требованиями внутренних документов клиринговой организации.

Требования, предусмотренные подпунктами 1), 2) и 3) настоящего пункта, не распространяются на юридическое лицо, сделки (заявки) которого, заключаемые (объявляемые) на фондовой и (или) товарной бирже, заключаются (объявляются) с полным предварительным обеспечением.

Сноска. Пункт 5 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

6. Клиринговые участники торгов:

1) предоставляют клиринговой организации информацию о своей деятельности, необходимую для осуществления мониторинга финансового состояния клиринговых участников торгов, а также соответствия клиринговых участников торгов требованиям правил клиринговой организации, в объеме, порядке и сроки, предусмотренные правилами клиринговой организации;

2) уплачивают взносы и сборы клиринговой организации в порядке, предусмотренном правилами клиринговой организации.

7. Клиринговый участник торгов уведомляет клиринговую организацию о наложении судами, органами дознания и следствия или органами исполнительного производства по находящимся в их производстве уголовным и

гражданским делам и делам исполнительного производства ареста на имущество, принадлежащее клиринговому участнику торгов и (или) его клиентам, не позднее дня, следующего за днем наступления таких событий.

Сноска. Пункт 7 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

8. Основанием для приостановления действия или лишения статуса клирингового участника торгов являются:

1) приостановление или прекращение действия лицензии, выданной клиринговому участнику торгов уполномоченным органом или уполномоченным органом в области регулирования торговой деятельности;

2) приостановление или прекращение членства на фондовой и (или) товарной бирже;

3) временное или постоянное отключение лица, подключенного к системе подтверждения фондовой биржи, от данной системы подтверждения;

4) основания, установленные правилами клиринговой организации.

Сноска. Пункт 8 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

9. Клиринговая организация уведомляет уполномоченный орган обо всех случаях получения, отказа в получении, приостановления, возобновления и прекращения действия статуса клирингового участника торгов не позднее следующего рабочего дня после наступления такого случая.

10. Уполномоченный орган уведомляет клиринговую организацию о приостановлении или прекращении действия лицензии клирингового участника торгов в день направления соответствующего уведомления в адрес данного клирингового участника торгов.

Клиринговая организация не обслуживает клирингового участника торгов, действие лицензии которого было приостановлено или прекращено, с даты получения указанного уведомления, за исключением клиринговой деятельности, связанной с исполнением обязательств (завершением расчетов) по ранее заключенным сделкам (ранее определенным (чистым) позициям) данного клирингового участника торгов.

Сноска. Пункт 10 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-1. Обязательства клиента (клирингового участника торгов) клиринговой организации прекращаются на дату, определенную в соответствии с правилами клиринговой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-1 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-2. Клиринговая организация прекращает клиринговое обслуживание клиента (клирингового участника торгов) клиринговой организации в день получения письменного уведомления уполномоченного органа о лишении лицензии клиента (клирингового участника торгов) - финансовой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-2 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-3. Все обязательства клиента (клирингового участника торгов) клиринговой организации по сделкам, заключенным до даты получения уведомления уполномоченного органа о лишении лицензии клирингового участника торгов - финансовой организации, подлежат исполнению в течение расчетного периода на условиях и в порядке, установленных правилами клиринговой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-3 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-4. Обязательства по сделкам прекращаются возникновением нетто-обязательств (нетто-требований) клирингового участника торгов в отношении других клиринговых участников торгов - его контрагентов по сделкам. Размер указанных нетто-обязательств (нетто-требований) рассчитывается в соответствии с правилами клиринговой организации, и соответствующее уведомление о рассчитанной сумме направляется клиринговому участнику торгов в форме электронного документа.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-4 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-5. Клиринговая организация направляет клиринговому участнику торгов, лишенному лицензии, а также его контрагентам уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим сделкам.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-5 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по

истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

10-6. Возврат денег клиринговому участнику торгов осуществляется клиринговой организацией в течение 3 (трех) рабочих дней после получения клиринговой организацией письма о возврате денег от клирингового участника торгов, содержащего платежные реквизиты.

Возврат денег клиринговому участнику торгов осуществляется клиринговой организацией в сумме нетто-требования клирингового участника торгов, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном правилами клиринговой организации.

Порядок осуществления возврата денег клиринговой организацией клиринговому участнику торгов в иных случаях устанавливается правилами клиринговой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 10-6 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

3. Осуществление клиринга

11. Клиринговая организация осуществляет сбор, обработку и хранение информации по сделкам, по которым данная клиринговая организация осуществляет клиринговое обслуживание, ее сверку, корректировку при наличии расхождений, изменение (реквизитов) сторон сделки или совершение иных действий при урегулировании дефолта по сделке на условиях и в порядке, определенных Правилами и правилами клиринговой организации.

Для осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами, клиринговая организация заключает договор с расчетной организацией, организатором торгов и (или) товарной биржей, условия которого предусматривают порядок обмена информацией между сторонами договора и совершение согласованных процедур в процессе реализации сторонами договора своих прав и обязанностей.

Сноска. Пункт 11 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

11-1. Клиринговая организация осуществляет процедуры по урегулированию дефолта клирингового участника торгов путем подачи заявок и заключения сделок с финансовыми инструментами в торговой системе фондовой и (или) товарной биржи от имени данного клирингового участника торгов (с целью

принудительной ликвидации его открытых позиций) и (или) совершения иных действий в порядке и на условиях, определенных правилами клиринговой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 11-1 в соответствии с постановлением Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

12. Клиринговая организация осуществляет хранение информации и документов, связанных с клиринговой деятельностью, и ежедневное резервное копирование такой информации.

Резервные копии подлежат защите от несанкционированного доступа к информации и хранятся в резервном техническом центре клиринговой организации до их замены обновленными резервными копиями.

13. Клиринговая организация обеспечивает постоянную готовность резервного технического центра к немедленной активизации. Резервный технический центр соответствует следующим требованиям:

1) содержит резервные копии информации, связанной с клиринговой деятельностью, идентичные основной информации;

2) содержит копию программно-технического обеспечения клиринговой организации, используемого в процессе осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами;

3) располагается не менее чем в двадцати пяти километрах от места нахождения клиринговой организации;

4) обеспечивается коммуникациями, необходимыми для осуществления деятельности клиринговой организации;

5) при невозможности осуществления клиринга по месту нахождения клиринговой организации представляет возможность осуществления клиринга не позднее, чем на следующий рабочий день после возникновения данной ситуации.

14. Допускается использование клиринговой организацией резервного центра центрального депозитария или фондовой биржи.

15. В целях осуществления клиринга между клиринговыми участниками торгов в результате заключения сделок с финансовыми инструментами, клиринговая организация обеспечивает достоверный учет параметров заключенных сделок в торговой системе организатора торгов и (или) на товарной бирже.

16. Расчетной организацией по сделкам с ценными бумагами является центральный депозитарий.

16-1. Порядок и условия осуществления расчетов по заключенным на биржевых торгах сделкам с производными финансовыми инструментами и (или) валютой, определяются правилами фондовой биржи.

Клиринговая организация для организации расчетов (платежей) по сделкам с производными финансовыми инструментами и (или) валютой открывает счета для учета финансовых инструментов в соответствии с требованиями внутренних документов клиринговой организации.

Сноска. Правила дополнены пунктом 16-1 в соответствии с постановлением Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

17. Требования и (или) обязательства клиринговых участников торгов рассчитываются клиринговой организацией и передаются в расчетную организацию путем передачи приказа на проведение расчетов (платежей) одним из следующих способов:

1) в режиме реального времени, на основании каждой отдельной сделки без проведения взаимозачета требований и обязательств по другим сделкам клиринговых участников торгов в порядке очередности их регистрации в торговой системе организатора торгов или на товарной бирже;

2) по итогам торговой сессии, по окончании которой осуществляется взаимозачет требований и обязательств клиринговых участников торгов и определяются их чистые позиции после проведения клиринговой сессии.

18. Действие пункта 17 Правил не распространяется на сделки с ценными бумагами, заключенные в торговой системе организатора торгов, расчет по которым осуществляется в день их заключения по принципу "поставка против платежа".

Передача приказа в расчетную организацию на проведение расчетов (платежей) по сделкам с ценными бумагами, указанным в части первой настоящего пункта, осуществляется согласно внутренним документам организатора торгов.

Сноска. Пункт 18 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

19. Клиринговая организация формирует отчет по результатам клиринговой деятельности для клиринговых участников торгов в порядке и сроки, определенные правилами клиринговой организации.

Сноска. Пункт 19 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 27.05.2014 № 98 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

20. Расчетная организация на основании полученных приказов осуществляет расчеты (платежи) и уведомляет об этом клиринговую организацию.

Сноска. Пункт 20 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 27.05.2014 № 98 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

4. Раскрытие информации о деятельности клиринговой организации

21. Клиринговая организация обеспечивает раскрытие информации о своей деятельности и свободный доступ к ознакомлению с информацией, не составляющей коммерческую тайну на рынке ценных бумаг, всем заинтересованным лицам путем публикации (размещения) на постоянной основе указанной информации в средствах массовой информации на государственном и русском языках.

22. На интернет-ресурсе клиринговой организации обеспечивается раскрытие следующей информации:

1) общей информации о клиринговой организации (состав органов клиринговой организации, фамилии, имена, при наличии отчества руководящих работников клиринговой организации, место нахождения клиринговой организации, контактные телефоны);

2) учредительных документов клиринговой организации;

3) правил клиринговой организации;

4) годовой и ежеквартальной финансовой отчетности клиринговой организации, включая финансовую отчетность, подтвержденную аудиторской организацией, и аудиторского отчета;

5) информации о клиринговых участниках торгов с указанием наименования клирингового участника торгов, даты и номера выданной ему лицензии, даты присвоения (приостановления действия, лишения) статуса клирингового участника торгов, основания приостановления действия (лишения) статуса клирингового участника торгов;

6) наименовании организаторов торгов и (или) товарных бирж, обслуживаемых клиринговой организацией, с указанием рынков, видов финансовых инструментов и сделок (методов торгов), принимаемых на обслуживание клиринговой организацией;

7) наименовании расчетных организаций;

8) информации, подлежащей раскрытию в соответствии с законодательством Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, об акционерных обществах и правилами клиринговой организации.

23. Клиринговая организация обеспечивает свободный доступ к ознакомлению с информацией, перечень которой определен пунктом 22 настоящих Правил.

5. Правила клиринговой организации

24. Правила клиринговой организации разрабатываются ее исполнительным органом и утверждаются советом директоров клиринговой организации.

Сноска. Пункт 24 в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

24-1. Клиринговая организация в течение 10 (десяти) рабочих дней со дня утверждения правил клиринговой организации либо внесения в них изменений и (или) дополнений уведомляет об этом уполномоченный орган с приложением подтверждающих документов.

Сноска. Правила дополнены пунктом 24-1 в соответствии с постановлением Правления Национального Банка РК от 30.05.2016 № 146 (вводится в действие по истечении двадцати одного календарного дня после дня его первого официального опубликования).

25. Исключен постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

26. Исключен постановлением Правления Национального Банка РК от 28.01.2016 № 12 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

27. Правила клиринговой организации определяют условия и порядок осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами, и включают положения, определяющие:

1) требования к клиринговым участникам торгов с указанием их прав и обязанностей, в том числе обязанности по поддержанию финансовой устойчивости клирингового участника торгов;

2) порядок и условия присвоения (приостановления действия, лишения) статуса клирингового участника торгов;

3) перечень информации о деятельности клиринговых участников торгов, предоставляемой ими клиринговой организации для осуществления мониторинга финансового состояния клиринговых участников торгов, соответствия клиринговых участников торгов требованиям правил клиринговой организации, а также порядок и сроки предоставления данной информации;

- 4) порядок распоряжения информацией, полученной клиринговой организацией от клиринговых участников торгов и уполномоченного органа;
- 5) порядок мониторинга финансового состояния клиринговых участников торгов, а также соответствия клиринговых участников торгов требованиям правил клиринговой организации;
- 6) порядок и условия формирования специальных клиринговых (гарантийных) фондов, а также порядок и условия уплаты взносов и сборов клиринговой организации;
- 7) порядок и условия формирования клиринговой организацией резервных фондов;
- 8) порядок сбора, обработки и хранения информации по заключенным сделкам, ее сверки и корректировки при наличии расхождений;
- 9) порядок учета и подтверждения клиринговой организацией параметров заключенных сделок с финансовыми инструментами;
- 10) порядок определения требований и (или) обязательств клиринговых участников торгов;
- 11) порядок, условия и способы исполнения обязательств по результатам клиринговой деятельности;
- 12) порядок предоставления клиринговой организацией отчетов клиринговым участникам торгов по результатам клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами;
- 13) порядок подготовки и передачи информации по результатам клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами расчетной организации, организатору торгов и (или) товарной бирже;
- 14) типовые формы договоров об осуществлении клирингового обслуживания, определяющего отношения между клиринговой организацией и клиринговыми участниками торгов;
- 15) требования к содержанию договора, заключаемого клиринговой организацией с расчетной организацией, организатором торгов и (или) товарной биржей;
- 16) порядок и условия исполнения клиринговой организацией функций центрального контрагента;
- 17) положения, определение которых необходимо для реализации функций клиринговой организации, установленных статьей 77-2 Закона Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг".

Сноска. Пункт 27 в редакции постановления Правления Национального банка РК от 04.07.2012 № 205 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

28. Документы, перечисленные в пункте 27 настоящих Правил, составляют правила клиринговой организации и оформляются в качестве отдельных документов клиринговой организации либо включаются в состав единых правил клиринговой организации.

© 2012. РГП на ПХВ «Институт законодательства и правовой информации Республики Казахстан»
Министерства юстиции Республики Казахстан