

Подключение к TC ASTS+ и технические вопросы

1. **Вопрос:** Как получить тестовые ФАСТИ-ключи для АРМ «Депонент» и «Банк-Клиент»?

Ответ: Для получения тестовых ключей, необходимо направить запрос в свободной форме на почту hkm@kase.kz с указанием Наименования компании и контактов.

2. **Вопрос:** Как подключиться к торговой системе TC ASTS+?

Ответ: К TC ASTS+ можно подключиться четырьмя разными способами:

1. Терминальное подключение с использованием приложения Trade SE International;
2. При помощи универсального двунаправленного шлюза ASTS Bridge для подключения внешних систем к TC ASTS+;
3. С использованием протокола FIX;
4. С использованием протокола FAST;

Подробные инструкции по подключению можно получить по адресу https://kase.kz/ru/kase_moex_connection/. Для каждого типа подключения необходимо создавать отдельные учетные записи в ТК МОЕХ.

3. **Вопрос:** Как создать тестовую учетную запись в новой торговой системе ASTS+?

Ответ: Для создания тестовой учетной записи в TC ASTS+ необходимо направить письменный запрос по электронной почте на адрес Службы поддержки KASE (support@kase.kz).

4. **Вопрос:** Как получать ExecutionReport в сервисе FIX?

Ответ: Сервис FIX состоит из трех независимых сервисов:

- Торгового MFIXTrade – предназначенного для ввода и отмены заявок и получения отчетов об их исполнении в основных режимах торгов;
- Информационного MFIXTradeCapture – предназначенного для получения информации о сделках, включая переговорные сделки, сделки РЕПО, отчеты на исполнение и компенсационные взносы;
- Информационного MFIXDropCopy – предназначенного для получения отчетов об обработке заявок и сделок основных режимов торгов;

Инструкцию ExecutionReport необходимо отслеживать в сервисе MFIXDropCopy;

5. **Вопрос:** Кому можно задавать технические вопросы касающиеся TC ASTS+?

Ответ: Все технические вопросы нужно направлять по электронной почте на адрес Службы поддержки KASE (support@kase.kz);

Зачисление/списание денежных средств

1. **Вопрос:** В процессе перехода на новую TC ASTS+, как будут синхронизироваться позиции в новой и в старой платформе?

Ответ: Позиции не будут синхронизироваться. В новой TC ASTS+ необходимо зачислять новые денежные средства и финансовые инструменты. В старой TC ACT необходимо будет оставить часть позиций под открытые обязательства и исполнить в день расчетов.

2. **Вопрос:** Как будут зачисляться/списываться финансовые инструменты (ФИ) в новой TC ASTS+?

Ответ: В ЦД у каждого участника торгов и его клиента открыт лицевой счет, имеющий два раздела: «Основной (AVAIL)» и «Биржа (KASE)». Если ФИ находятся на разделе «Основной (AVAIL)», то остатки по ним попадают в старую TC ACT. Если ФИ находятся на разделе «Биржа (KASE)», то остатки по ним попадают в новую TC ASTS+. Для перевода ФИ между разделами используется ПО АРМ «Депонент» предоставляемое Центральным депозитарием. По вопросам зачисления ФИ на тестовые счета просьба направить письменный запрос в ЦД по электронной почте на адрес VerkutalimovT@kacd.kz.

3. Вопрос: Как будут зачисляться денежные средства (ДС) в новую ТС ASTS+?

Ответ: В ЦД Биржа открывает корреспондентский счет. Зачисление денег на корсчет Биржи, осуществляется посредством перевода с банковского счета в ЦД или других источников (через КЦМР) с использованием ПО АРМ «Банк-клиент» Центрального депозитария либо отправкой SWIFT(МТ) сообщения в ЦД(для участников торгов не использующих ПО АРМ «Банк-клиент».

Обязательно в поле «Назначение платежа» указать признак денежных средств:

- OWNI – Собственные денежные средства;
- CLTI – Клиентские-агрегированные денежные средства;
- KASI – Кастодиальные – агрегированные денежные средства;

4. Вопрос: Как будут выводиться денежные средства (ДС) из новой ТС ASTS+?

Ответ: Для вывода денежных средств необходимо отправить XML файл (структура сообщения описана в примерах) на Биржу по средством ПО eTransfer. Сообщения следует отправлять при помощи тестового eTransfer (31.31.219.115:5500) для пользователя SKASE004 (тестовый пользователь KASE).

Вывод денежных средств доступен в валютах KZT и USD со следующих торговых счетов:

- с собственного счета (S+/OWNI);
- с клиентского агрегированного (L+/ CLTI);
- с клиентского счета (I+/ CLTI/I+1*****);
- с кастодиального агрегированного (K+/ KASI);
- с кастодиального клиентского (C+/ KASI/C+1000000000);

Пример №1 - Средства будут выведены с собственного счета S+.

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<MESSAGE>
  <NUMBER>38</NUMBER>
  <DATETIME>03.07.2019 13:00:55</DATETIME>
  <FIRMCODE>Код фирмы</FIRMCODE>
  <BIN>БИН</BIN>
  <CURRENCY>KZT</CURRENCY>
  <AMOUNT>3000.00</AMOUNT>
  <ACCOUNTTYPE>OWNI</ACCOUNTTYPE>
  <IBAN>KZ0000000000000000</IBAN>
  <TRADER>Иванов М.М.</TRADER>
</MESSAGE>
```

Пример №2 - Средства будут выведены с клиентского агрегированного счета L+.

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<MESSAGE>
  <NUMBER>38</NUMBER>
  <DATETIME>03.07.2019 13:00:55</DATETIME>
  <FIRMCODE>Код фирмы</FIRMCODE>
  <BIN>БИН</BIN>
  <CURRENCY>KZT</CURRENCY>
  <AMOUNT>3000.00</AMOUNT>
  <ACCOUNTTYPE>CLTI</ACCOUNTTYPE>
  <IBAN>KZ0000000000000000</IBAN>
  <TRADER>Иванов М.М.</TRADER>
</MESSAGE>
```

Пример №3 - Средства будут выведены с клиентского счета I+.

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<MESSAGE>
  <NUMBER>17</NUMBER>
  <DATETIME>17.09.2019 11:10:00</DATETIME>
  <FIRMCODE>Код фирмы</FIRMCODE>
  <BIN>БИН</BIN>
  <CURRENCY>KZT</CURRENCY>
  <AMOUNT>3687.20</AMOUNT>
  <ACCOUNTTYPE>CLTI/I+1000000000</ACCOUNTTYPE>
  <IBAN>KZ0000000000000000</IBAN>
  <TRADER>Иванов М.М.</TRADER>
</MESSAGE>
```

Пример №4 - Средства будут выведены с кастодиального агрегированного счета K+.

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<MESSAGE>
  <NUMBER>38</NUMBER>
  <DATETIME>03.07.2019 13:00:55</DATETIME>
  <FIRMCODE>Код фирмы</FIRMCODE>
  <BIN>БИН</BIN>
  <CURRENCY>KZT</CURRENCY>
  <AMOUNT>3000.00</AMOUNT>
  <ACCOUNTTYPE>KASI</ACCOUNTTYPE>
  <IBAN>KZ0000000000000000</IBAN>
  <TRADER>Иванов М.М.</TRADER>
</MESSAGE>
```

Пример №5 - Средства будут выведены с кастодиального клиентского счета C+.

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<MESSAGE>
  <NUMBER>17</NUMBER>
  <DATETIME>17.09.2019 11:10:00</DATETIME>
  <FIRMCODE>Код фирмы</FIRMCODE>
  <BIN>БИН</BIN>
  <CURRENCY>KZT</CURRENCY>
  <AMOUNT>3687.20</AMOUNT>
  <ACCOUNTTYPE>KASI/C+1000000000</ACCOUNTTYPE>
  <IBAN>KZ0000000000000000</IBAN>
  <TRADER>Иванов М.М.</TRADER>
</MESSAGE>
```

5. **Вопрос:** Как сегрегировать денежные средства с клиентского-агрегированного (L+/K+(счет кастодиана)) на клиентские (I+/C+(клиенты кастодиана)) торговые счета?

Ответ:

- 1) **Перевод денег на один клиентский (I+/C+) счет:** TC ASTS – Меню – Действие – Заявка на перевод – Ввести для денег (Shift+F6) – Ввести параметры перевода (**Списать с L+/K+, Зачислить на I+/C+**) – Ввести заявку.
- 2) **Перевод денег на большое количество клиентских (I+/C+) счетов:** TC ASTS – Меню – Действие – Ввести пакет...(Ctrl+F2) – Вкладка Перевод денег – Загрузить – Выбрать файл с подготовленным шаблоном – Проверить список загруженного пакета (**поле «торговый счет» - L+/K+, поле «торговый счет партнера» - I+/C+**)- Ввести весь пакет

6. **Вопрос:** Как агрегировать денежные средства с клиентских (I+/C+(клиенты кастодиана)) торговых счетов на клиентский-агрегированный (L+/K+(счет кастодиана))?

Ответ:

3) **Перевод денег с одного клиентского (I+/C+) счета:** TC ASTS – Меню – Действие – Заявка на перевод – Ввести для денег (Shift+F6) – Ввести параметры перевода (**Списать с I+/ C+, Зачислить на L+/K+**) – Ввести заявку.

4) **Перевод денег с большого количества клиентских (I+/C+) счетов:** TC ASTS – Меню – Действие – Ввести пакет...(Ctrl+F2) – Вкладка Перевод денег – Загрузить – Выбрать файл с подготовленным шаблоном – Проверить список загруженного пакета (**поле «торговый счет» - I+/C+, поле «торговый счет партнера» - L+/K+**)- Ввести весь пакет

Функциональные возможности TC ASTS+

1) **Вопрос:** Нужно ли открывать новые счета для торговли на новой TC ASTS+?

Ответ: Все счета будут автоматически переведены в новую систему.

Заключение сделок с ЦК будет осуществляться в TC ASTS+ с торгово-клиринговыми счетами (ТКС)

- с префиксом S+ по собственным деньгам клирингового участника,
- с префиксом I+ по сделкам клиентов Брокера/Банка как брокера,
- с префиксом C+ по сделкам кастоди клиентов.

В новой торговой системе все счета, открытые в ЦД будут привязаны со счетами, созданными для заключения сделок.

Для торговли в интересах клиентов Кастодианов по схеме «за счет клиента кастоди» Уполномоченному участнику торгов необходимо предоставить Бирже заявление участника торгов об открытии торгово-клирингового счета второго уровня в соответствии с приложением 5 Правил осуществления биржевой деятельности.

Клиринговому участнику – Пользователю системы контроля и обеспечения (Кастодиану), счета которого будут использоваться для расчетов по сделкам, заключаемым Уполномоченным участником торгов с ТКС 2-го уровня необходимо предоставить Бирже заявление клирингового участника о назначении в отношении его клирингового счета уполномоченного участника торгов – Брокера в соответствии с приложением № 2 Правил осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами.

Для торговли в интересах клиентов Кастодианов по схеме «за счет средств Брокера» с отдельного счета или для разделения сделок и позиций, осуществляемых с собственного ТКС S+ или клиентского ТКС I+ участники торгов могут предоставить Бирже заявление участника торгов об открытии ТКС 2-го уровня в соответствии с приложением 5 Правил осуществления биржевой деятельности

2) **Вопрос:** Как подгружать инструменты в торговую систему при подключении?

Ответ:

а) Подгрузка инструментов, одного рынка и режима.

После успешной авторизации, в появившемся диалоговом окне, в левой половине окна, необходимо выбрать требуемый «Рынок», а затем выбрать «Режим» в правой половине окна.

б) Подгрузка инструментов, нескольких, отдельных рынков или режимов.

После успешной авторизации, в появившемся диалоговом окне, в левой половине окна, удерживая нажатой клавишу **Ctrl**, необходимо выбрать несколько требуемых рынков, а затем, так же удерживая нажатой клавишу **Ctrl** выбрать несколько требуемых режимов в правой половине окна.

с) Подгрузка инструментов, нескольких, последовательных рынков или режимов.

После успешной авторизации, в появившемся диалоговом окне, в левой половине окна, удерживая нажатой клавишу **Shift**, необходимо выбрать несколько последовательно расположенных рынков, а затем, так же удерживая нажатой клавишу **Shift** выбрать несколько последовательно расположенных режимов в правой половине окна.

д) Подгрузка всех инструментов TC ASTS+.

После успешной авторизации, в появившемся диалоговом окне, необходимо нажать комбинацию клавиш Ctrl+A, будут выбраны все рынки в левой половине окна и все режимы в правой половине окна.

- 3) Вопрос:** Проверка обеспечения при подаче приказа останется как раньше в разрезе клиентов?
Ответ: Проверка обеспечения (частичного или полного) будет осуществлена в разрезе каждого клиента;
- 4) Вопрос:** Будет ли сохранена возможность подачи длинных заявок как в АСТ?
Ответ: Нет, в ТКС ASTS+ возможность подачи длинных заявок не предусмотрена.
- 5) Вопрос:** Будет ли сохранена возможность ввода двойной заявки?
Ответ: Нет, в ТКС ASTS+ возможность ввода двойной заявки не предусмотрена. Заявки на покупку и на продажу необходимо направлять отдельно. Предусмотрена возможность подачи заявок пакетным вводом.
- 6) Вопрос:** Почему в обязательствах маркет-мейкера по облигациям спред от цены, а не от доходности?
Ответ: В ТКС ASTS+ будут внесены изменения для расчета спреда между значениями доходностей;
- 7) Вопрос:** Будет ли предусмотрено время предварительных торгов для выполнения обязательств маркет-мейкером?
Ответ: Время предварительных торгов не будет предусмотрено. На время адаптационного периода (один календарный месяц) Правлением Биржи будет рассмотрен вопрос о неприменении санкций к маркет-мейкеру по ценным бумагам, торгующимися в ТКС ASTS+, предусмотренных Правилами деятельности маркет-мейкеров;
- 8) Вопрос:** Можно ли установить параметры контроля заявок?
Ответ: Да, для этого необходимо зайти в Сервис → Контроль параметров заявок → Установить;
- 9) Вопрос:** Можно ли установить, автоматический флаг по заявкам маркет-мейкера?
Ответ: Да, можно. Если пользователь является маркет-мейкером по инструменту, по которому он вводит заявку, то в диалоге ввода заявки будет автоматически установлен соответствующий флаг. Для этого необходимо зайти в Сервис → Параметры → Спец. настройки и установить "Устанавливать флаг "Заявка маркет-мейкера для бумаг маркет-мейкера";
- 10) Вопрос:** Почему мы не видим ранее заключенные сделки купли-продажи в таблице "Сделки"?
Ответ: Таблица "Сделки" ежедневно очищается. Информацию по всем сделкам репо, заключенным в предыдущие и текущий торговые дни можно посмотреть в Таблице - «Сделки на исполнение». Информацию по нетто-позициям, обязательствам и требованиям получить в таблицах "Обязательства и требования по деньгам", "Обязательства и требования по бумагам" и "Обязательства и требования по активам";

11) Вопрос: Почему при заключении сделки репо, в сделках отображаются три операции (П/К, П, К), как правильно ориентироваться?

Ответ: При заключении одной операции репо отображается три сделки:

- 1) сделка репо витринная РПВ → в зависимости от направления сделки П/К (продажа/купля) или К/П (купля/продажа);
- 2) первая часть сделки репо РП1 → в зависимости от направления сделки П (продажа) или К (купля);
- 3) вторая часть сделки репо РП1 → в зависимости от направления сделки К (купля) или П (продажа).

12) Вопрос: Возможно ли досрочное закрытие репо?

Ответ: В ТКС ASTS+ возможно изменение даты закрытия для сделок прямого репо на более ранний срок;

13) Вопрос: Отсутствие изменения единого лимита после подачи заявок или заключения сделок репо/авторепо?

Ответ: При заключении сделки репо изменение единого лимита не существенно. В связи с тем, что пока вы не забрали деньги или бумаги с клирингового счета по результатам расчетов получаемые активы по первой ноге еще учитываются как обеспечение и не приводят к изменению единого лимита. В момент заключения сделки – это только процентный риск – он не существенный. Изменение происходит при выгоне денег или бумаг;

14) Вопрос: Почему позиции по торговым счетам менялись только при прямой сделке?

Ответ: При заключении сделки с ценными бумагами списка Т+ до расчета клиринга меняется расчетная позиция (вам нужно ее либо добавить в таблице «Позиции по деньгам» либо прокрутить правее). По итогам клиринга (по завершении клиринговой сессии) по деньгам изменяется плановая позиция, и на эту же сумму корректируется расчетная позиция, по бумагам изменяется входящая позиция и на эту же сумму корректируется расчетная позиция

15) Вопрос: Почему заявка была принята несмотря на отсутствие средств на счете С+ в USD на момент принятия заявки?

Ответ: Потому что данная бумага торгуется на условиях частичного обеспечения, код расчетов со способом обеспечения "Y" - обозначает контроль частичного обеспечения при подаче заявки.

16) Вопрос: Можно ли поставить контроль по остаткам?

Ответ: Контролировать остатки на текущую дату вы можете как по деньгам так и по ценным бумагам по любому торгово-клиринговому счету в таблицах "Позиция по деньгам", "Позиция по инструментам на счетах депо", а также на любую расчетную дату в 3-х таблицах «Обязательства и требования» по столбцу "Плановая Т+".

"Плановая Т+" показывает прогнозный доступный остаток на соответствующую дату расчетов с учетом всех заключенных сделок до этой даты расчетов.

Есть возможность установить признаки «запрет необеспеченных продаж» и(или) «запрет необеспеченных покупок» на любом ТКС клиентском или собственном. Для перевода ТКС на торговлю с полной предоплатой возникающих обязательств по ценным бумагам устанавливается запрет коротких продаж в Таблица-Торговые счета, с полной предоплатой возникающих обязательств по деньгам устанавливается «запрет необеспеченных покупок» в Таблица-Расчетные коды.

17) Вопрос: Как получить биржевое свидетельство по сделкам через торговую систему?

Ответ: Биржевое свидетельство посредством новой торговой системы ASTS+ направляться не будет, биржевое свидетельство можно будет получить посредством ПО eTransfer.