

1. Как обеспечить поставку ценных бумаг для заключения сделок в режиме с ЦК и без ЦК?

Для заключения сделок в ТК ASTS+, как в режиме с ЦК, так и в режиме без ЦК, необходимо перевести ценные бумаги с раздела «Основной» на раздел «KASE» через систему АРМ Депонента ЦДЦБ; в обратном случае, ценные бумаги не отразятся на торговых счетах в ТК ASTS+.

2. Как подавать заявки авторепо и прямое репо в режиме без ЦК?

Для подачи заявки репо в режиме без ЦК необходимо выбрать в поле «Режим» окна заявки «Авторепо с корзиной с блокировкой» на количество дней, которое вас интересует либо «Прямое репо без ЦК» и использовать торговые счета с кодировками S0/SR, I0/IR.

S0/I0 – при подаче заявок на привлечение денег на собственный/клиентский счет по сделкам авторепо;

SR/IR – при подаче заявок на размещение денег с собственного/клиентского счета по сделкам авторепо;

S0/I0 – при подаче заявок на размещение/привлечение денег с/на собственный/клиентский счет по прямому репо.

3. Как происходят расчеты по сделкам репо в режиме без ЦК?

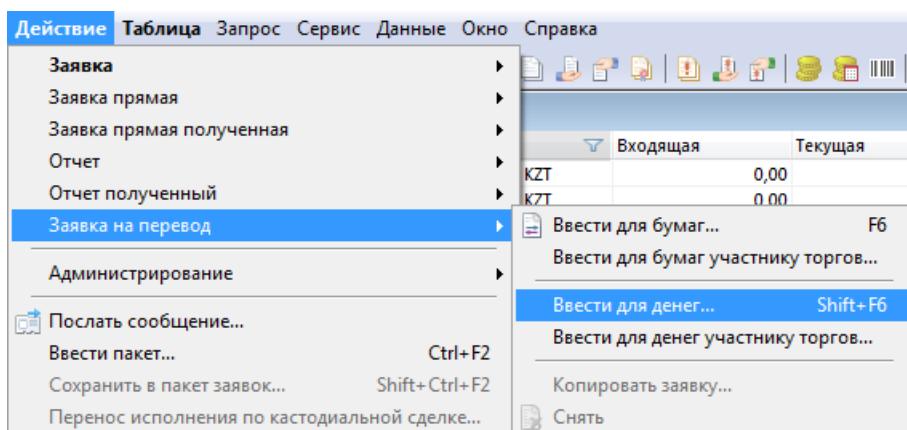
Сделки рассчитываются автоматически после их заключения на основе gross-расчетов и не привязаны к клиринговым сессиям Биржи. Соответственно, деньги, полученные от сделок репо, зачисляются на денежный счет контрапартнера в КЦМР (для банков) или ЦДЦБ (для брокеров) сразу же.

4. Как пополнить торговые счета денежными средствами для заключения сделок в режиме без ЦК?

Для заключения сделок в режиме без ЦК необходимо обеспечить денежными средствами торговые счета с кодировками S0/I0 (для кастодианов C0).

Участники торгов самостоятельно пополняют торговые счета денежными средствами через задачу «Ввести для денег» в ТК ASTS+, используя технический счет EXTRAN как дебетовый счет. Данное зачисление является виртуальным пополнением.

Сумма пополнения торговых счетов S0/I0 должна быть равной реальной сумме денежных средств на корреспондентском счете в КЦМР у банков и на корреспондентском счете в АО ЦДЦБ у брокеров. Обращаем внимание, что клиентские счета I0 (для кастодианов C0) пополняются через клиентский агрегированный счет L0 (для кастодианов через K0).



5. Что за счет EXTRAN?

EXTRAN – это технический счет, созданный в ТКС ASTS+ для возможности зачисления денег на счета S0/I0 без ограничений по суммам.

Данный счет физически не пополняется участниками торгов, а является «виртуальным мешком», при помощи которого можно осуществить зачисление денег на торговые счета S0/I0.

6. Как закрывается сделка авторепо в режиме без ЦК?

Вторая часть сделки авторепо со стороны покупателя (возвращает деньги) выполняется после отправки отчета на исполнение со стороны покупателя (возвращает деньги). Для отправки указанного отчета необходимо в окне "Сделки для исполнения" в день исполнения кликнуть правой кнопкой мыши по второй части сделки авторепо и выбрать команду "Ввести отчет на исполнение". Вторая часть сделки авторепо со стороны продавца (возвращает бумаги) выполняется автоматически в сессию mark-to-market (до 10:30).

Сделка №	Статус	Тип	Дата сделки	Дата исполнения	К/П	Инструмент	Цена	Лоты	Объем	Объем НКД	Сумма к исполнению	Ставка РЕПО, %	Код расчетов	Срок РЕПО	Торговый счет	Состояние расчетов
100 102 926 +		RP1	31.01.2020	31.01.2020	П	KZ_05_2410	106,7946	2 446	989 499,25	10 572,31	1 000 071,56	8,0000	Z0		Ю1027 01630	В расчетах
100 102 927 +		RP2	31.01.2020	03.02.2020	К	KZ_05_2410	106,8331	2 446	989 855,78	10 871,56	1 000 727,34	8,0000	Zc1		3 Ю1027 01630	В расчетах

7. Когда нужно поставить активы для обеспечения расчетов по сделкам репо, заключенных в режиме без ЦК?

Так как расчеты по сделкам не привязаны к клиринговым сессиям Биржи, активы нужно обеспечить на торговых и денежных счетах до момента намерения сторон заключить сделку: ценные бумаги на разделе KASE в ЦД, деньги в КЦМР (для банков) или ЦДЦБ (для брокеров).

8. Как подавать заявки репо в режиме с ЦК?

Для подачи заявки для заключения сделок репо в режиме с ЦК необходимо выбрать в поле «Режим» окна заявки «Авторепо с ЦК с корзиной» или «Авторепо с ЦК» на количество дней, которое вас интересует, либо «Прямое репо с ЦК», и использовать торговые счета с кодировками S+/I+.

S+/I+ – при подаче заявок на размещение/привлечение денег с/на собственный/клиентский счет по сделкам репо и авторепо.

9. Как происходят расчеты по сделкам репо в режиме с ЦК?

Сделки рассчитываются во время клиринговых сессий Биржи на основе нетто-расчетов. Активы будут доступны к выводу после завершения клиринговых сессий. Соответствующее сообщение о возможности вывода активов направляется по TKS ASTS+.

10. Как закрывается сделка авторепо в режиме с ЦК?

Вторая часть сделки репо закрывается автоматически без участия сторон сделки во время проведения клиринговых сессий Биржей.

11. Когда нужно поставить активы для обеспечения расчетов по сделкам репо, заключенных в режиме с ЦК?

Актуальный регламент клиринговых сессий просим смотреть на сайте Биржи www.kase.kz. На данный момент крайнее время поставки активов прописаны следующим образом.

Первая клиринговая сессия.

16:15 – это крайнее время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет KASE в ЦДЦБ – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 16:15 ALT.

Вторая клиринговая сессия.

17:45 - это крайнее время поставки клиринговыми участниками финансовых инструментов (денег – на корреспондентский счет KASE в ЦДЦБ – на раздел KASE) для исполнения нетто-требований / нетто-обязательств по сделкам с частичным обеспечением с наступившей датой исполнения, заключенным с 15:30 до 17:30 ALT с учетом сделок, заключенных в режимах самоурегулирования до 17:45 ALT.

12. Как узнать состав корзин репо?

Состав корзин репо можно узнать в реальном времени в TKS ASTS+ через команду «Активы корзин».

13. В какой колонке таблицы «Сделки» смотреть суммы сделок купли-продажи и репо по «грязной» цене?

Данная сумма содержится в колонке «Сумма» таблицы «Сделки», т.е. это есть «грязная» сумма сделки.

14. Цена, которая показана в таблице «Заявки», «Сделки» - это чистая цена сделки по долговым ценным бумагам, включая сделки репо?

Все верно, данная цена является «чистой» ценой сделки и показана до четырех знаков после запятой. По долговым ценным бумагам цена выражена в процентах к номинальной стоимости. «Грязная» цена сделок репо содержится в колонках «Цена размещения, тенге», «Цена выкупа, тенге» таблицы «Сделки».

15. Где можно узнать размер обеспечения (маржи) по ценной бумаге для заключения сделки купли-продажи?

Размер обеспечения (маржи) можно узнать в режиме реального времени в таблице «Активы» (колонка «Ставка риска падения цены, %», «Ставка риска роста цены, %») команды «Риск-параметры» в меню «Запросы» главного меню TKS ASTS+.

16. Где можно узнать размер дисконта по ценной бумаге для заключения сделки репо без ЦК?

Размер дисконта можно узнать в режиме реального времени в таблице «Активы» (колонка «Дисконт РЕПО, %») команды «Риск-параметры» меню «Запросы» TKS ASTS+.

17. Как рассчитывается сумма поданной заявки по корзине репо?

Если заявка подается на размещение денег в режиме с ЦК, то сумма репо рассчитывается по цене самой дорогой по стоимости ценной бумаги, находящейся в корзинах РЕПО, торгуемых в режиме с ЦК с учетом количества лотов в заявке.

Если заявка подается на размещение денег в режиме без ЦК, то сумма репо рассчитывается по цене с учетом размера дисконта самой дорогой по стоимости ценной бумаги, находящейся в корзине РЕПО, торгуемых в режиме без ЦК с учетом количества лотов в заявке.

Если заявка подается на привлечение денег в режиме с ЦК, то сумма репо рассчитывается путем умножения количества ценных бумаг, отдаваемых в залог, на расчетную цену без учета размера дисконта.

Если заявка подается на привлечение денег в режиме без ЦК, то сумма репо рассчитывается путем умножения количества ценных бумаг, отдаваемых в залог, на расчетную цену с учетом размера дисконта.

18. Как рассчитывается сумма закрытия репо?

Сумма закрытия РЕПО = Сумма открытия РЕПО * $[1 + (r * n) / (100 * act)]$,

где

r – ставка операции репо;

n – срок операции репо, в календарных днях;

act – календарное количество дней в году.

19. Почему при умножении количества долговых ценных бумаг по сделке репо на чистую цену, не выходим на суммы закрытия репо?

В ТКС ASTS+ «чистая» цена в колонке «Цена выкупа» выражена в процентах и округлена до четвертого знака после запятой, а также не включает в себя НКД. Для вычисления суммы закрытия репо необходимо использовать формулу указанную в пункте 18 или вычислить ее путем умножения количества долговых ценных бумаг по сделке репо на цену выкупа в тенге. Данные поля есть в таблицах "Сделки" и "Сделки для исполнения".

20. Где можно увидеть количество ценных бумаг в штуках, являющихся залоговым обеспечением по сделкам репо с корзиной?

Количество ценных бумаг в штуках содержится в колонке «Бумаг к исполнению» таблиц «Сделки для исполнения» и «Заявки» в поле «Бумаг под залог» (по заявкам, поданным на привлечение денег).

21. Чем отличаются параметры «Цена размещения» от «Цены размещения, в тенге» в таблице «Сделки»?

«Цена размещения» указывает цену ценной бумаги в предмете котирования. Для облигаций - это «чистые» цены в процентах. «Цена размещения, тенге» указывает цену ценной бумаги в деньгах.

22. Что за режимы SMAL, SMAD?

Это сектора мелких лотов, в которых можно заключать сделки купли-продажи, где количество ценных бумаг в заявках не привязано к размеру лота, т.е. есть возможность купить-продать количество ценных бумаг меньше лота, установленного по такой ценной бумаге.

23. Почему некоторые долговые ценные бумаги торгуются в режиме «Т0 Акции» и заведены как акции?

Данные долговые ценные бумаги в силу своих характеристик могут торговаться в торговых системах Биржи только по «грязной» цене и эта цена выражена в деньгах, а не в процентах к номинальной стоимости, т.е. это цена аналогична цене по долевым ценным бумагам.

24. Расскажите про биржевые отчеты по сделкам, заключенным в TCK ASTS+?

Биржевые отчеты предоставляются участникам торгов по системе eTransfer в конце торгового дня Биржи.

Биржевые отчеты в зависимости от типа операций и типа участника торгов делятся на несколько видов:

- для кастодианов

биржевые отчеты по сделкам, заключенным в режиме с ЦК;

биржевые отчеты по сделкам, заключенным в режиме без ЦК;

биржевые отчеты по специальным торгам/аукционам;

биржевые отчеты по кастодиальным переводам;

- для брокеров

биржевые отчеты по сделкам, заключенным в режиме с ЦК;

биржевые отчеты по сделкам, заключенным в режиме без ЦК;

биржевые отчеты по специальным торгам/аукционам;

биржевые отчеты по кастодиальным переводам.

25. Как участники торгов могут выгрузить сведения из таблицы ТКС ASTS+ в формате Excel на свои рабочие станции?

ТКС ASTS+ предоставляет возможность выгрузить в режиме реального времени сведения из активного окна любой таблицы торговой системы через команду «Сохранить» - «Файл» в меню «Данные» главного меню. Также есть возможность настройки динамического экспорта данных системы через команду «Динамический экспорт» - «Новый экспорт» в меню «Данные» главного меню.

26. Какой порядок подключения к сервисам MOEX с ЭЦП?

С 01 июля 2020 года подключение к терминалу Trade SE, FIX (Trade, Trade Capture, Drop Copy), ASTS Bridge по интернет-каналу производится только с использованием ЭЦП КЦМР.

За получением ЭЦП КЦМР необходимо обращаться в ТОО "eTrade.kz".

Подключение к терминалу Trade SE, FIX (Trade, Trade Capture, Drop Copy), FAST по выделенному каналу производится без ЭЦП.

27. Какие существуют варианты (каналы) подключения к сервисам MOEX?

Подключение по интернет-каналу:

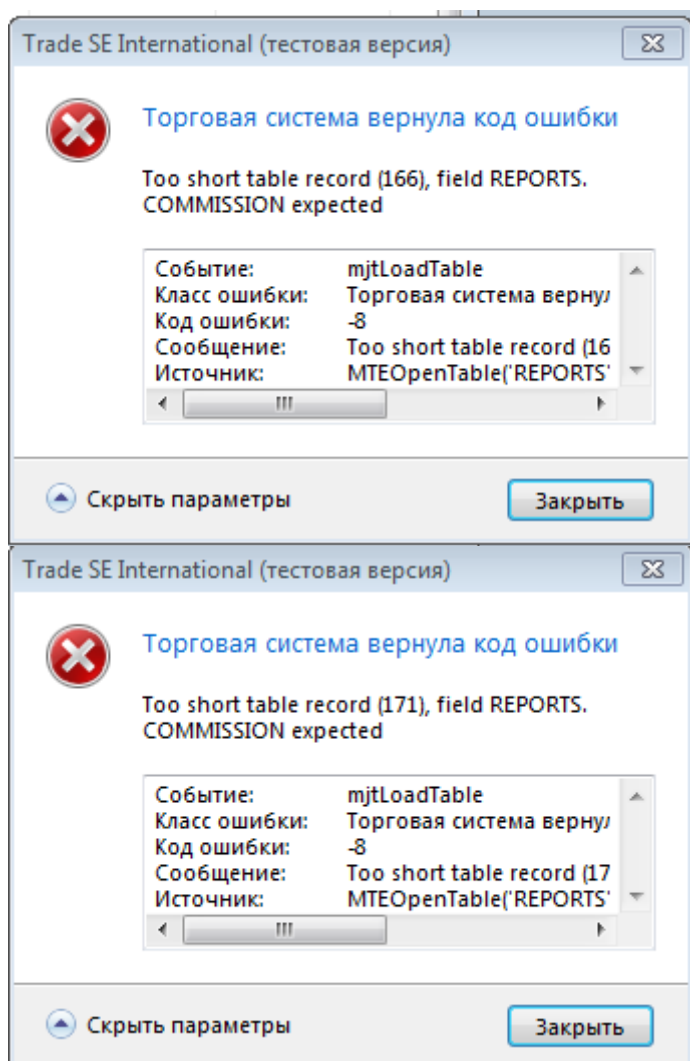
- терминал Trade SE International
- FIX (Trade, Trade Capture, Drop Copy)
- ASTS Bridge

Подключение по выделенной линии:

- терминал Trade SE International
- FIX (Trade, Trade Capture, Drop Copy)
- FAST.

28. Торговая система вернула код ошибки: Too short table record (166) (171), field REPORTS. COMMISSION expected (терминал Trade SE, MOEX). В чем дело?

Скриншоты ошибки:



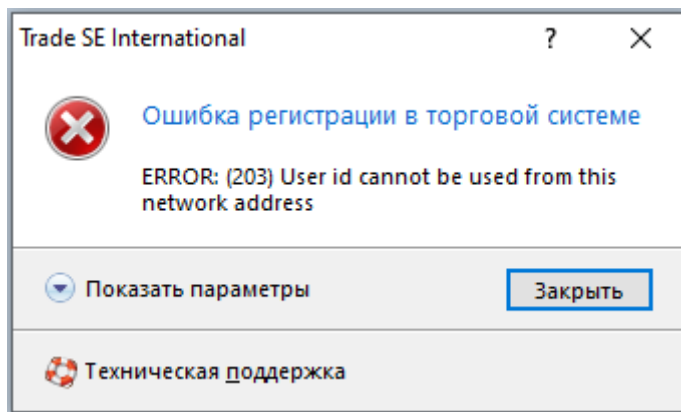
Причина ошибки: не срабатывает автоматическое обновление торгового терминала в связи с тем, что у пользователя нет полных прав на папку, в которой установлен терминал.

Варианты устранения:

- 1) обратиться в своё ИТ-подразделение с запросом о предоставлении полных прав на папку, в которой установлен терминал Trade SE;
- 2) установить терминал Trade SE заново, при этом выполнять установку на рабочий стол компьютера (папка с терминалом должна находиться на рабочем столе).

29. [Как устранить ошибку регистрации в торговой системе error 203: User id cannot be used from this network address \(терминал Trade SE, MOEX\)?](#)

При авторизации в терминале ASTS+ (Trade SE International) выходит ошибка:



Данная учетная запись не имеет возможности подключаться к торговому терминалу, а выдана для подключения через шлюзовые системы, такие как FIX, FAST, ASTS Bridge.

30. Изменение пароля учетной записи для FIX MOEX

Поменять пароль можно в сообщении 35=A, тег смены пароля 925=новый пароль.

Пример заполнения поля 925: 925 NewPassword H String(8) Новый пароль для SenderCompID(49). (Максимальная длина 8 символов).

Если использовалось это поле, то последующие сессии должны использовать указанный в данном поле пароль в поле 554.