АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н ы

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 12 декабря 2024 года № 147)

Введены в действие

с 05 января 2025 года

ТРЕБОВАНИЯ

к системам DMA членов АО "Казахстанская фондовая биржа" и их использованию

г. Алматы

2024

Настоящие Требования разработаны в соответствии с Правилами предоставления прямого доступа к торговой системе АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) и устанавливают требования к системам DMA членов Биржи и их использованию.

1. Используемая членом Биржи система DMA должна:

   1) транслировать DMA-клиентам в режиме реального времени из торговой системы Биржи (с учетом требования, установленного пунктом 2 настоящих Требований):

      сведения о финансовых инструментах, обращающихся в торговой системе Биржи, и их ценах (согласно действующим заявкам на заключение сделок и заключенным сделкам);

      сведения о ходе и результатах торгов финансовыми инструментами, обращающимися в торговой системе Биржи;

   2) позволять DMA-клиентам:

      формировать клиентские заказы;

      передавать клиентские заказы в электронном виде члену Биржи для осуществления им процедур регистрации, проверки, верификации, учета и исполнения клиентских заказов;

      фиксировать точное время передачи клиентских заказов члену Биржи;

   3) формировать заявки на заключение сделок в торговой системе Биржи на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов и подавать такие заявки в торговую систему Биржи;

   4) предоставлять DMA-клиентам в режиме реального времени точные сведения (с учетом требования, установленного пунктом 2 настоящих Требований):

      о статусах клиентских заказов, подлежащих регистрации, проверке, верификации и исполнению;

      о статусах заявок, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов;

      о статусах и этапах подтверждения сделок, заключенных в торговой системе Биржи на основе указанных заявок;

      об исполнении указанных сделок или о причинах их неисполнения;

      о позициях и/или имеющемся (полном или частичном) обеспечении для подачи заявок и/или заключения сделок в торговой системе Биржи;

   5) позволять DMA-клиентам в соответствии с внутренними документами Биржи изменять условия заявок, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов, или аннулировать такие заявки;

   6) позволять члену Биржи формировать и отправлять DMA-клиентам уведомления об отказах в исполнении их клиентских заказов, сформированных с использованием системы DMA, с указанием причин таких отказов[1];

   7) поддерживать возможность ведения log-файла, в котором отражаются все операции по взаимодействию с торговой системой Биржи, совершенные с ее использованием, а также их результаты (подача и снятие заявок, заключение сделок, получение информации о ходе торгов и т.д.);

---

[1] Например, по причине нарушения DMA-клиентом установленного для него лимита, по причине аннулирования заявки, сформированной на основе клиентского заказа DMA-клиента, по причине неисполнения сделки, которая была заключена в торговой системе Биржи на основе заявки, сформированной на основе клиентского заказа DMA-клиента.

8) предусматривать возможность восстановления после нештатных ситуаций:
   - прерывание сетевого подключения к торговой системе;
   - перезапуск системы DMA в течение торгового дня;
   - перезапуск торговой системы, требующий повторной загрузки данных;
   - перезапуск торговой системы, не требующий повторной загрузки данных;
   - переключение на резервные или дублирующие серверы доступа к торговой системе (возможно выполнение переключения в "ручном" режиме).

2. Временной промежуток между моментами обновления информации на шлюзе и на рабочем месте DMA-клиента в системе DMA не должен превышать 60 секунд.

3. Помимо требований, указанных в пунктах 1 и 2 настоящих Требований, используемая членом Биржи система DMA должна позволять устанавливать, как минимум, следующие лимиты для DMA-клиентов:

   1) максимальный объем одного клиентского заказа (в деньгах и/или в единицах финансового инструмента);

   2) лимиты отклонения цен финансовых инструментов, указанных в клиентских заказах;

   3) максимальный срок действия заявки DMA-клиента;

   4) иные лимиты в соответствии с запретами, ограничениями и особыми условиями, установленными законодательством Республики Казахстан и внутренними документами Биржи.

4. Описание системы DMA, используемой членом Биржи, должно содержать следующие сведения (но не ограничиваясь только ими):

   1) об операционной системе, системах управления базами данных и шлюзе, используемых для работы системы DMA и ее подключения к торговой системе Биржи;

   2) о показателях производительности системы DMA, в том числе:

      о максимальном количестве заявок, которые могут быть сформированы системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов и поданы в торговую систему Биржи, за одну секунду;

      о максимальном количестве одновременно обслуживаемых DMA-клиентов на одном сервере члена Биржи;

      о временном промежутке, необходимом для формирования в системе DMA клиентского заказа и активизации соответствующей заявки в торговой системе Биржи;

      о временном промежутке, необходимом для передачи информации из торговой системы Биржи в систему DMA или на рабочее место DMA-клиента в системе DMA;

      о временном промежутке между моментами обновления информации на шлюзе и на рабочем месте DMA-клиента в системе DMA;

   3) об условиях и порядке копирования, резервирования и архивирования данных, обеспечивающих бесперебойность работы системы DMA;

   4) об электронной цифровой подписи и/или о системах криптографической защиты информации, используемой (используемых) в системе DMA для обеспечения конфиденциальности и неизменности данных, передаваемых и получаемых системой DMA (с учетом требования, установленного пунктом 5 настоящих Требований);

   5) об условиях и порядке:

      управления запуском системы DMA и остановкой ее работы;

      управления подключением системы DMA к торговой системе Биржи и отключением системы DMA от торговой системы Биржи;

      контроля за состоянием соединения системы DMA с торговой системой Биржи;

6) об условиях установления и применения лимитов, устанавливаемых в системе DMA в соответствии с пунктом 3 настоящих Требований;

7) об условиях и порядке администрирования:

лимитов, устанавливаемых в системе DMA в соответствии с пунктом 3 настоящих Требований;

прав, запретов, ограничений, особых условий, устанавливаемых в системе DMA в отношении отдельного DMA-клиента;

настроек процедур обработки клиентских заказов DMA-клиентов;

8) об условиях и порядке осуществления членом Биржи процедур регистрации, проверки, верификации, учета и исполнения клиентских заказов, полученных им через систему DMA;

9) о функциях, поддерживаемых системой DMA, например, о группах финансовых инструментов, к которым DMA-клиентам предоставляется прямой доступ, о видах заявок, которые могут быть сформированы системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов, о видах новостей, графиков, оповещений (уведомлений), транслируемых (предоставляемых) DMA-клиентам через систему DMA;

10) пояснительные материалы (схемы, рисунки, скриншоты) к отдельным сведениям из числа предусмотренных настоящим пунктом;

11) иные сведения, позволяющие объективно оценить систему DMA и уровень ее соответствия нормам законодательства Республики Казахстан и внутренних документов Биржи.

5. В случае использования в системе DMA электронной цифровой подписи, зарегистрированной в соответствии с законодательством иного, помимо Республики Казахстан, государства, член Биржи обязан по первому требованию любого заинтересованного лица предоставить ему сведения об этой подписи и ее регистрации, а также предоставить ему для ознакомления и/или копирования копию регистрационного свидетельства, подтверждающего такую регистрацию.

6. Ответственность за своевременное внесение изменений и/или дополнений (актуализация) в настоящие Требования возлагается на подразделение торгов.

7. Настоящие Требования подлежат актуализации по мере необходимости. Настоящие Требования подлежат пересмотру на необходимость в актуализации не реже одного раза в 36 месяцев, исчисляемых со дня введения в действие настоящих Требований, а в случае их актуализации – со дня введения в действие последних изменений/дополнений.

Председатель Правления Алдамберген А. Ө.