

Приложение 3

к Положению об условиях  
коммерческого представления  
биржевой информации

## ТЕХНИЧЕСКАЯ СПЕЦИФИКАЦИЯ архивной торговой информации

### 1. Справочник продукта

Код продукта	KASE_HIST
Периодичность	По запросу
Историческая	Да
Формат	CSV, XLS

### 2. Формат архивной торговой информации

Формат архивной торговой информации, предоставляемой в виде информационных срезов по итогам торгов, соответствует формату информации об итогах торгов (приложение 2). Формат архивной информации предоставляемой в виде реестра заявок и реестра сделок, приводится ниже.

#### 2.1. Реестр заявок

№ поля	Наименование	Описание
1.	Date	Дата
2.	Time	Время подачи заявки
3.	Inst_Type	Тип инструмента ( <b>E</b> – долевого инструмента, <b>D</b> – долгового инструмента, <b>DY</b> – инструмента денежного рынка (репо <sup>7</sup> ), <b>F</b> – производные ценные бумаги, <b>IS</b> – исламские ценные бумаги, <b>FX</b> – иностранная валюта (спот-рынок), <b>SW</b> – операция валютного свопа <sup>5</sup> )
4.	Sec_Type	Вид ценной бумаги (где применимо, <b>1</b> – государственная, <b>2</b> – корпоративная, <b>3</b> – иное)
5.	Issuer_rus	Наименование эмитента на русском языке (где применимо)
6.	Issuer_eng	Наименование эмитента на английском языке (где применимо)
7.	Symbol	Код инструмента
8.	ISIN	Международный идентификационный код ценной бумаги (где применимо)
9.	ISIN	Международный идентификационный код ценной бумаги (где применимо) <sup>6</sup>
10.	<i>(Данная строка исключена решением Правления Биржи от 19 ноября 2019 года)</i>	
11.	Buy/Sell	Направление заявки ( <b>Buy</b> – покупка, <b>Sell</b> – продажа) <sup>8</sup>

<sup>7</sup> Учитываются только сделки открытия.

<sup>8</sup> Для рынка операций репо направление "покупка" означает намерение участника купить предмет

№ поля	Наименование	Описание
12.	Ord_Type	Тип заявки ( <b>T</b> – рыночная, <b>N</b> – договорная)
13.	Ord_Type_2	Тип заявки ( <b>L</b> – лимитированная, <b>M</b> – рыночная)
14.	Currency	Валюта котирования
15.	Market_Sector	Сектор ( <b>1</b> – регулярные торги, <b>2</b> – специализированные торги)
16.	P_type	Тип цены (предмет котирования) ( <b>CP</b> – "чистая" цена в % от номинала, <b>DP</b> – "грязная" цена в % от номинала, <b>P</b> – "грязная" цена в валюте котирования, <b>Y</b> – доходность в % годовых)
17.	Exp_Date	Дата исполнения контракта (для производных инструментов)
18.	Settle_Price	Расчетная цена (для производных инструментов)
19.	Price	Цена
20.	Yield	Доходность к погашению для покупателя по заявленной цене (для облигаций)
21.	Volume	Объем заявки в количестве инструмента
22.	Value_KZT	Объем заявки, тенге
23.	Value_USD	Объем заявки, долларов США
24.	DTM	Дней до погашения (для облигаций)

## 2.2. Реестр сделок

№ поля	Наименование	Описание
1.	Date	Дата
2.	Time	Время сделки
3.	Inst_Type	Тип инструмента ( <b>E</b> – долевого инструмента, <b>D</b> – долгового инструмента, <b>DY</b> – инструмент денежного рынка (репо <sup>7</sup> ), <b>F</b> – производные ценные бумаги, <b>IS</b> – исламские ценные бумаги, <b>FX</b> – иностранная валюта (спот-рынок), <b>SW</b> – операция валютного свопа*)
4.	Sec_Type	Вид ценной бумаги (где применимо, <b>1</b> – государственная, <b>2</b> – корпоративная, <b>3</b> – иное)
5.	Issuer_rus	Наименование эмитента на русском языке (где применимо)
6.	Issuer_eng	Наименование эмитента на английском языке (где применимо)
7.	Symbol	Код инструмента
8.	ISIN	Международный идентификационный код ценной бумаги (где применимо)
9.	ISIN	Международный идентификационный код ценной бумаги (где применимо) <sup>6</sup>
10.	<i>(Данная строка исключена решением Правления Биржи от 19 ноября 2019 года)</i>	
11.	T_Type	Тип сделки ( <b>T</b> – рыночная, <b>N</b> – договорная)

операции репо, "продажа" – намерение участника продать предмет операции репо.

<b>№ поля</b>	<b>Наименование</b>	<b>Описание</b>
12.	Currency	Валюта котирования
13.	Market_Sector	Сектор ( <b>1</b> – регулярные торги, <b>2</b> – специализированные торги)
14.	P_type	Тип цены (предмет котирования) ( <b>CP</b> – "чистая" цена в % от номинала, <b>DP</b> – "грязная" цена в % от номинала, <b>P</b> – "грязная" цена в тенге, <b>Y</b> – доходность в % годовых)
15.	Exp_Date	Дата исполнения контракта (для производных инструментов)
16.	Settle_Date	Дата расчетов
17.	Settle_Price	Расчетная цена (для производных инструментов)
18.	Price	Цена
19.	Yield	Доходность по сделке для покупателя к погашению (для облигаций)
20.	Volume	Объем сделки в количестве инструмента
21.	Value_KZT	Объем сделки, тенге
22.	Value_USD	Объем сделки, долларов США
23.	DTM	Дней до погашения (для облигаций)