

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н ы

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 08 января 2014 года № 1)

Введены в действие

с 10 февраля 2014 года

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

г. Алматы

2014

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 05 сентября 2019 года № 103);
- введены в действие с 03 декабря 2019 года.

Настоящие Требования разработаны в соответствии с Правилами предоставления прямого доступа к организованному рынку ценных бумаг, утвержденными решением Биржевого совета АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) (протокол заседания от 28 ноября 2013 года № 29), и устанавливают требования к системам DMA¹ членов Биржи, а также к основным условиям и порядку предоставления членами Биржи своим DMA-клиентам² прямого доступа к организованному рынку ценных бумаг (далее – прямой доступ).

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;

¹ Согласно Правилам предоставления прямого доступа к организованному рынку ценных бумаг, утвержденным решением Биржевого совета (протокол заседания от 28 ноября 2013 года № 29), система DMA – комплекс программно-технических средств члена Биржи, который взаимодействует с программно-техническим комплексом Биржи и предназначен для заключения сделок в торговой системе Биржи на основе заявок, сформированных на основе клиентских заказов DMA-клиентов.

² Согласно Правилам предоставления прямого доступа к организованному рынку ценных бумаг, утвержденным решением Биржевого совета (протокол заседания от 28 ноября 2013 года № 29), DMA-клиент – клиент члена Биржи, использующий систему DMA для заключения членом Биржи от своего имени сделок в торговой системе Биржи по поручению и/или за счет и/или в интересах данного клиента.

- 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 отказов³.
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)⁴;
 - 2) лимиты отклонения цен финансовых инструментов, указанных в клиентских заказах⁵;
 - 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);

³ 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.

⁴ Например, в соответствии со значениями, указанными в статье 4 закона Республики Казахстан "О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных незаконным путем, и финансированию терроризма".

⁵ Например, в соответствии со значениями, установленными законодательством Республики Казахстан или внутренними документами Биржи в отношении цен, указываемых в заявках членов Биржи.

- 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 секторах организованного рынка ценных бумаг, 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 Казахстан⁶ 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. Договор об оказании брокерских услуг, заключаемый (заключенный) членом Биржи с DMA-клиентом, должен содержать следующие нормы:
- 1) о требованиях члена Биржи к финансовому состоянию (устойчивости) DMA-клиента, к программно-техническому обеспечению рабочего места DMA-клиента, а также – если DMA-клиент является юридическим лицом – к содержанию инвестиционной декларации DMA-клиента или иного документа, определяющего его инвестиционные предпочтения, к организации системы управления рисками DMA-клиента;
 - 2) об обязанности члена Биржи по предоставлению DMA-клиенту описания системы DMA и инструкции пользователя, а также по поддержанию этих описания и инструкции в актуальном состоянии;

⁶ Например, нормам Инструкции к программно-техническим средствам и иному оборудованию, необходимым для осуществления деятельности на рынке ценных бумаг, утвержденной постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 апреля 2012 года № 165, нормам Правил осуществления брокерской и дилерской деятельности на рынке ценных бумаг Республики Казахстан, утвержденных постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 27 августа 2005 года № 317.

- 3) о необходимости знания DMA-клиентом содержания законодательства Республики Казахстан и внутренних документов Биржи, регулирующих условия и порядок заключения сделок в торговой системе Биржи и их исполнения, прежде всего внутренних документов Биржи по вопросам предоставления прямого доступа, работы системы контроля и обеспечения, профессиональной этики и делового поведения (*данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 05 сентября 2019 года*);
о необходимости знания DMA-клиентом размеров комиссионных и иных сборов Биржи и иных субъектов организованного рынка ценных бумаг, а также размеров неустоек за нарушения условий и порядка совершения сделок с финансовыми инструментами;
- 4) о недопустимости формирования и передачи DMA-клиентом клиентских заказов и совершения им иных действий, которые ведут или могут привести к нарушению норм законодательства Республики Казахстан, внутренних документов Биржи, а также к отступлению от обычаев делового оборота;
- 5) о лимитах, правах, запретах, ограничениях, особых условиях, устанавливаемых (установленных) в отношении DMA-клиента в системе DMA и/или в торговой системе Биржи, о значениях таких лимитов;
- 6) о возможности аннулирования (без ведома, желания или согласия DMA-клиента, в соответствии с законодательством Республики Казахстан и/или внутренними документами Биржи) заявок на заключение сделок в торговой системе Биржи, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов DMA-клиента;
- 7) об условиях и порядке аннулирования (без ведома, желания или согласия DMA-клиента, в соответствии с внутренними документами члена Биржи⁷) заявок на заключение сделок в торговой системе Биржи, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов DMA-клиента;
- 8) о возможности неисполнения сделок, которые были заключены в торговой системе Биржи на основе заявок, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов DMA-клиента;
- 9) об осуществлении мониторинга членом Биржи, Биржей и государственным органом по надзору и контролю за финансовым рынком и финансовыми организациями:
клиентских заказов, сформированных с использованием системы DMA;
заявок на заключение сделок в торговой системе Биржи, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов DMA-клиента;
сделок, которые были заключены в торговой системе Биржи на основе заявок, сформированных системой DMA на основе полученных членом Биржи через систему DMA и зарегистрированных им клиентских заказов DMA-клиента;
- 10) о возможности привлечения DMA-клиента к ответственности за нарушение условий и порядка совершения сделок;
- 11) о запрете на передачу DMA-клиентом права прямого доступа другим лицам и на оказание DMA-клиентом услуг другим лицам по предоставлению прямого доступа;
- 12) об условиях и порядке приостановления, возобновления, прекращения допуска DMA-клиента к системе DMA.

⁷ Например, в случаях, когда у члена Биржи имеются основания полагать, что заключение сделки ведет или может привести к нарушению норм законодательства Республики Казахстан, внутренних документов Биржи, внутренних документов члена Биржи.

Президент

Джолдасбеков А.М.