

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Басқармасының шешімімен
(2024 жылдың 12 желтоқсанындағы
№ 147 отырыс хаттамасы)

б е к і т і л д і

2025 жылдың 05 қаңтарынан бастап
қолданысқа енгізілді

DMA жүйесін сертификаттау жөніндегі НҰСҚАУЛЫҚ

Осы Нұсқаулық Қазақстан Республикасының заңнамасына және "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) мүшелерінің өз клиенттеріне Биржаның сауда-саттық жүйесіне тікелей қол жеткізуді ұсыну жөніндегі қызметтерді көрсету шарттары мен тәртібін белгілейтін Биржаның ішкі құжатына сәйкес әзірленді, DMA жүйесін¹ сертификаттау тәртібін белгілейді.

1 бап. Жалпы қағидалар

1. Осы Нұсқаулықта пайдаланылатын ұғымдар Биржаның басқа ішкі құжаттарында немесе Қазақстан Республикасының заңнамасында анықталған ұғымдарға ұқсас.
2. Биржа өз клиенттеріне Биржаның сауда-саттық жүйесіне тікелей қрұқсаттаманы ұсыну жөнінде Биржа мүшелерінің қызмет көрсету шарттары мен тәртібін анықтайтын өзінің ішкі құжатында белгіленген талаптарға сәйкес DMA жүйесін сертификаттауды жүргізеді.
3. Биржа ұсынатын бағдарламалық хаттамалар арқылы Биржаның сауда-клирингтік жүйесіне қосылу үшін қолданылатын DMA жүйелері сертификаттауға жатады.
4. Сертификаттаудан өту мақсаттары үшін DMA жүйесі Биржа мүшелерінің DMA жүйелеріне, сондай-ақ Биржа мүшелерінің өзінің DMA-клиенттеріне Биржаның сауда-саттық жүйесіне тікелей рұқсаттама беруінің негізгі шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптарды белгілейтін Биржаның ішкі құжатының талаптарына сәйкес келуі тиіс.

2 бап. ASTS+ FIX-хаттамасымен жұмыс істеуге арналған DMA жүйесін сертификаттау

1. FIX-хаттама бойынша ASTS+-ке қосылуды сертификаттау кезінде:
 - 1) өтінімдерді табысты қою/алу; транзакцияны қате қалыптастырудан туындаған өтінімдерді қою кезінде қателердің болмауы. Drop Copy және Trade Capture сервистері үшін сауда-саттық операциялары бойынша тесттерді орындау міндетті емес;
 - 2) 11-тэг – ClOrdID және онымен бірге <Parties> тобын дұрыс пайдалану (тиісті клиенттік коды бар клиенттік шоттан өтінімді дұрыс қою);
 - 3) сессияны қалпына келтіргеннен кейін Resend Request бағдарламасын дұрыс пайдалану;
 - 4) "құпиясөзді ауыстыру" (Login хабарламасының арнайы өрісінде жаңа құпиясөзді көрсету) және "сауда-саттық жүйесінің жауап тілін ауыстыру" (Login хабарламасының арнайы өрісінде тілді көрсету) транзакцияларын табысты орындау тексеріледі.
2. FIX-хаттама арқылы қосылуды сертификаттаудан өту үшін Биржа мүшесі осы Нұсқаулыққа 1 немесе 2 қосымшада сипатталған барлық сценарийлерді орындауға және өзінің DMA жүйесінің алынған лог-файлдарын (сол жұмыс күні) support@kase.kz жіберуге тиіс.

¹ Биржаның сауда-саттық жүйесіне тікелей қол жеткізуді ұсыну ережелеріне сәйкес DMA жүйесі – Биржаның бағдарламалық-техникалық кешенімен өзара іс-қимыл жасайтын және DMA-клиенттердің клиенттік тапсырыстары негізінде қалыптастырылған өтінімдер негізінде Биржаның сауда-саттық жүйесінде мәмілелер жасасуға арналған Биржа мүшесінің бағдарламалық-техникалық құралдарының кешені.

3 бап.

Bridge-бен жұмыс істеу үшін DMA жүйесін сертификаттау

1. Bridge хаттамасы бойынша қосылымды сертификаттау кезінде мыналар тексеріледі:
 - 1) ақпараттық сұрау салулардың дұрыстығы (кестелерді ашу және оларды жаңарту);
 - 2) жұмыс аяқталғаннан кейін сауда-саттық жүйесінен дұрыс ажырату;
 - 3) транзакцияны қате қалыптастырудан туындаған өтінімдерді қою кезінде қателердің болмауы;
 - 4) шлюз интерфейсінің сертификаттау сәтіндегі соңғы өзекті нұсқасын пайдалану;
 - 5) бағдарламалық қамтамасыз ету сауда-саттық жүйесімен жұмыс істеу кезінде құпиясөзді ауыстыру транзакциясын бере білуге міндетті, бұл транзакцияны беру сертификаттаудан табысты өтудің міндетті кезеңі болып табылады;
 - 6) деректерді алуға сұрау жиілігіне шектеу қою мүмкіндігі.
2. Bridge арқылы қосылуды сертификаттаудан өту үшін Биржа мүшесі осы баптың 1 тармағында сипатталған барлық іс-әрекеттерді орындауға және өзінің DMA жүйесінің алынған лог-файлдарын (сол жұмыс күні) support@kase.kz жіберуге тиіс.

4 бап.

SPECTRA FIX-хаттамасымен жұмыс істеуге арналған DMA жүйесін сертификаттау

FIX-хаттама арқылы қосылуды сертификаттаудан өту үшін Биржа мүшесі осы Нұсқаулыққа 3 қосымшада сипатталған барлық сценарийлерді орындауға және өзінің DMA жүйесінің алынған лог-файлдарын “DMA жүйесін талдау және сертификаттау үшін” белгісімен (сол жұмыс күні) қатаң түрде мынадай форматта support@kase.kz жіберуге тиіс: Аты-хабарламалар (өріс1 = мәні1, өріс2 = мәні,...)

Мысал: NewOrderSingle (blockLength=46, templateId=6000, schemaId=19781, version=2, ClOrdID=102, ExpireDate=18446744073709551615L, Price=100000, SecurityID=347990, ClOrdLinkId=7895424, OrderQty=5, TimeInForce=0, Side=1, CheckLimit=1, Account='AAAA').

5 бап.

SPECTRA TWIME-сервисімен жұмыс істеуге арналған DMA жүйесін сертификаттау

TWIME-сервис арқылы қосылуды сертификаттаудан өту үшін Биржа мүшесі осы Нұсқаулыққа 4 қосымшада сипатталған барлық сценарийлерді орындауға және өзінің DMA жүйесінің алынған лог-файлдарын “DMA жүйесін талдау және сертификаттау үшін” белгісімен (сол жұмыс күні) қатаң түрде мынадай форматта support@kase.kz жіберуге тиіс: Аты-хабарламалар (өріс1 = мәні1, өріс2 = мәні,...)

Мысал: NewOrderSingle (blockLength=46, templateId=6000, schemaId=19781, version=2, ClOrdID=102, ExpireDate=18446744073709551615L, Price=100000, SecurityID=347990, ClOrdLinkId=7895424, OrderQty=5, TimeInForce=0, Side=1, CheckLimit=1, Account='AAAA').

6 бап.

Тұжырымды қағидалар

1. Осы Нұсқаулыққа өзгертулерді және/немесе толықтыруларды уақтылы енгізу (өзектендіру) үшін жауапкершілік ақпараттық технологиялар бөлімшесіне және Биржаның сауда-саттық бөлімшесіне жүктеледі.

2. Осы Нұсқаулық қажеттілігіне қарай өзектендіруге жатады. Осы Нұсқаулық қолданысқа енгізілген күннен бастап есептелетін 36 айда кемінде бір рет өзектендіру қажеттілігіне, ал ол өзектендірілген жағдайда – соңғы өзгертулер/толықтырулар қолданысқа енгізілген күннен бастап қайта қаралуға тиіс.

Басқарма төрайымы

А.Ө. Алдамберген

ASTS+ (қор нарығы) FIX-хаттамасына қосылатын DMA жүйесі жұмысының С Ц Е Н А Р И Й І

1 тест. Қосылымды орнату және аяқтау

1-1 тест. Сессияны орнату

Биржаның мүшесі Биржадан алынған өзінің SenderCompID-ін көрсету арқылы жүйеге қосылуы тиіс.

Биржа мүшесінің бағдарламалық қамтамасыз етуі Logon және HeartBeat хабарларын жібереді.

Тест автоматты түрде жүргізіледі, қосымша әрекеттер талап етілмейді.

Күтілетін нәтиже: қосылысты орнату және жүйеден растау алу.

1-2 тест. Сессияның аяқталуы

Биржа мүшесі 1 минуттан кейін жүйеден дұрыс ажыратылуы тиіс.

Жүйеге қайта қосылу.

Күтілетін нәтиже: Жүйені дұрыс ажырату және қайта қосу.

2 тест. Сауда-саттық өзара іс-қимылы

2-1 тест. БҚ (GROSS) бойынша өтінім беру

Өтінімді мынадай жүйе қабылдайды:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент <шоттан> <шектелімге сәйкес келетін> бағасымен тестілік акцияны сатып алуға шектелімді өтінім береді. Өтінім мөлшері – 100 акция
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-2 тест. Акцияларды сатуға ұзақ мерзімді өтінімнің орналастырылуын тексеру. (REPO)

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент өзінің шотынан <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тест контурында қол жетімді кез келген> БҚ сатып алуға/сатуға шектелімді өтінім береді. Орындау тәртіптемесі – T+
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-3 тест. Бұрын орналастырылған өтінімнің алынғанын тексеру.

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент бұрын берілген өтінімнің ID бойынша бұрын орналастырылған өтінімді алып тастауға нұсқау береді
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-4 тест. Өзгертуге өтінім беруді тексеру.

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент өзінің шотынан <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тест контурында қол жетімді кез келген> Б) сатып алуға/сатуға шектелімді өтінім береді
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді
3.	Клиент	Клиент алынған OrigCIOrdID (бұрын берілген өтінімнің ID) бойынша бұрын берілген өтінімнің бағасын өзгертеді. Жаңа баға алдыңғыдан өзгеше болуы тиіс
4.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-5 тест. Өтінім мәртебесін сұрату

2-1 тестінде берілген өтінімнің мәртебесін анықтау

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент алынған CIOrdID бойынша 2-1 тестінде қойылған өтінім мәртебесіне сұрау салады
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-6 тест. Өтінімдерді жаппай алып тастау

Тестілеу процесінде қалыптастырылған барлық қолжетімді өтінімдерді алып тастау:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент өтінімдерді жаппай алуға сұрау салады, Order Mass Cancel Repor
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді. Өтінімдер жойылады

DMA жүйесін сертификаттау
жөніндегі нұсқаулыққа

2 қосымша

**ASTS+ (валюта нарығы) FIX-хаттамасына қосылатын DMA
жүйесі жұмысының
СЦЕНАРИЙІ**

1 тест. Қосылымды орнату және аяқтау

1-1 тест. Сессияны орнату

Биржаның мүшесі биржадан алынған өзінің SenderCompID-ін көрсету арқылы жүйеге қосылуы тиіс.

Биржа мүшесінің бағдарламалық қамтамасыз етуі Logon және HeartBeat хабарларын жібереді.

Тест автоматты түрде жүргізіледі, қосымша әрекеттер талап етілмейді.

Күтілетін нәтиже: Қосылысты орнату және жүйеден растау алу.

1-2 тест. Сессияның аяқталуы

Биржа мүшесі 1 минуттан кейін жүйеден дұрыс ажыратылуы тиіс.

Жүйеге қайта қосылу.

Күтілетін нәтиже: Жүйені дұрыс ажырату және қайта қосу.

2 тест. Сауда-саттық өзара іс-қимылы

2-1 тест. БҚ (GROSS) бойынша өтінім беру

Өтінімді мынадай жүйе қабылдайды:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент <шоттан> <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тестілік контурда кез келген қол жетімді> тестілік валюта жұбын сатып алуға шектелімді өтінім береді
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-2 тест. Бұрын орналастырылған өтінімнің алынғанын тексеру.

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент бұрын берілген өтінімнің ID бойынша бұрын орналастырылған өтінімді алып тастауға нұсқау береді
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-3 тест. Өзгертуге өтінім беруді тексеру.

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент өз шотынан <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тестілік контурда кез келген қол жетімді> валюталық жұпты сатып алуға/сатуға шектелімді өтінім береді
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

3.	Клиент	Клиент алынған OrigCOrdID (бұрын берілген өтінімнің ID) бойынша бұрын берілген өтінімнің бағасын өзгертеді. Жаңа баға алдыңғыдан өзгеше болуы тиіс
4.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-4 тест. Өтінім мәртебесін сұрату

2-1 тестінде берілген өтінімнің мәртебесін анықтау

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент алынған COrdID бойынша 2-1 тестінде қойылған өтінім мәртебесіне сұрау салады
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-5 тест. Өтінімдерді жаппай алып тастау

Тестілеу процесінде қалыптастырылған барлық қолжетімді өтінімдерді алып тастау:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Клиент өтінімдерді жаппай алуға сұрау салады, Order Mass Cancel Repor
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді. Өтінімдер жойылады

DMA жүйесін сертификаттау
жөніндегі нұсқаулыққа

3 қосымша

SPECTRA FIX-хаттамасына қосылатын DMA жүйесі жұмысының С Ц Е Н А Р И Й І

1 тест. Қосылымды орнату және аяқтау

1-1 тест. Сессияны орнату

Биржаның мүшесі сауда-саттықты ұйымдастыруға және өткізуге жауапты Биржаның бөлімшесінен алынған өзінің SenderCompID-ін көрсетіп, жүйеге қосылуы тиіс.

Биржа мүшесінің бағдарламалық қамтамасыз етуі Logon және HeartBeat хабарларын жіберуі тиіс. Тест автоматты түрде жүргізіледі, арнайы әрекеттер талап етілмейді.

1-2 тест. Сессияның аяқталуы

Биржа мүшесі 1 минуттан кейін жүйеден дұрыс ажыратылып, қайта қосылуы тиіс.

2 тест. Сауда-саттық өзара іс-қимылы

2-1 тест. Фьючерске өтінім беру

Өтінімді мынадай жүйе қабылдайды:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Шоттан> <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тестілік контурда кез келген қол жетімді> тест фьючерстерін сатып алуға шектелімді өтінім беру қажет. Өтінім мөлшері – 5 келісімшарт
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-2 тест. Фьючерстерді сатуға ұзақ мерзімді өтінімді орналастыру.

Қолданылу мерзімі шектелмеген өтінімді орналастыру қажет:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Шоттан> <шектелімге сәйкес келетін> бағамен <тестілік контурда кез келген қол жетімді> тест фьючерстерін сатуға шектелімді өтінім беру қажет. Өтінім көлемі – 6 келісімшарт. Орындау тәртіптемесі – Good Till Date. Экспирация күні – кез келген
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-3 тест. Бұрын берілген өтінімді алып тастау

Орналастырылған (2-2 тестінде) өтінімді OrigClOrdID бойынша Биржа мүшесі алып тастауы тиіс:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Алынған OrigClOrdID (бұрын берілген өтінімнің ClOrdID) бойынша бұрын орналастырылған өтінімді алып тастауға нұсқау беру (алты келісімшартты сату)
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-4 тест. Өтінімді өзгерту

Фьючерстерді сатып алуға өтінім беру және OrigCLOrdID бойынша өзгерту:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Тестілік контурда қол жетімді кез келген> фьючерстерді сатып алуға шектелімді өтінім беру. Өтінімнің мөлшері – 10 келісімшарт. Орындау тәртіптемесі - Good Till Date. Экспирация күні – кез келген
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді
3.	Клиент	OrigCLOrdID (CLOrdID бұрын берілген өтінім) бойынша бұрын берілген өтінімнің бағасын өзгерту. Жаңа баға алдыңғыдан өзгеше болуы тиіс
4.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-5 тест. Ордер мәртебесін сұрату

2-1 тестінде берілген өтінімнің мәртебесін анықтау

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Алынған CLOrdID бойынша 2-1 тестінде ұсынылған өтінім мәртебесіне сұрау салу
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-6 тест. Өтінімдерді жаппай алып тастау

Тестілеу процесінде қалыптастырылған барлық қолжетімді өтінімдерді алып тастау:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Шотты> және MassCancelRequestType = 8 және MarketSegmentID = F тәртіптемелерін көрсету арқылы өтінімдерді жаппай алып тастауға сұрау салу
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді. Өтінімдер жойылады

SPECTRA TWIME-сервисіне қосылатын DMA жүйесі жұмысының С Ц Е Н А Р И Й І

1-тест. Қосылымды орнату және аяқтау

1-1 тест. Сессияны орнату

Биржаның мүшесі сауда-саттықты ұйымдастыруға және өткізуге жауапты Биржаның бөлімшесінен алынған өзінің TWIME логинін көрсетіп, жүйеге қосылуы тиіс.

Биржа мүшесінің бағдарламалық қамтамасыз етуі Establish хабарламасын және кем дегенде бір HeartBeat (яғни NextSeqNo = pull-мен Sequence хабарламасы) жіберуі тиіс. Тест автоматты түрде өтеді, пайдаланушының арнайы әрекеттері талап етілмейді.

1-2 тест. Сессия аяқталғаннан кейін Биржа мүшесі 1 минуттан кейін жүйеден дұрыс ажыратылып, қайта қосылуы тиіс.

2 тест. Сауда-саттық өзара іс-қимылы

2-1 тест. Фьючерске өтінім беру

"Күн" қолданылу мерзімі бар өтінім беру:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Тестілік контурда қол жетімді кез келген> фьючерстерді сатып алуға шектелімді өтінім беру. Өтінімнің мөлшері - 5 келісімшарт. Өтінім түрі – Day <0
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-2 тест. Фьючерстерді сатып алуға ұзын өтінім беру.

Қолданылу мерзімі шектеулі өтінім беру:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Шоттан> <шектегі сәйкес келетін> бағамен <тестілік контурда кез келген қол жетімді> фьючерстерді сатып алуға шектелімді өтінім беру. Өтінім мөлшері – 6 келісімшарт. Орындау тәртіптемесі GTD = <6. Экспирация күні – ағымдағы күннен өзгеше кез келген
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-3 тест. Бұрын берілген өтінімді алып тастау

Берілген өтінімді (2-1 немесе 2-2 тестінде) OrderID бойынша Биржа мүшесі алып тастауы тиіс:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	Алынған OrderID бойынша бұрын берілген өтінімді алып тастауға бұйрық беру, (алты келісімшартты сату)
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-5 тест. Өтінімді өзгерту

Фьючерстерді сатып алуға өтінім беру және ұсынылған өтінімді өзгерту:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Тестілік контурда қол жетімді кез келген> фьючерстерді сатып алуға шектелімді өтінім беру. Өтінімнің мөлшері – 10 келісім-шарт, < шоттан>). Өтінім түрі – Day <0
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді
3.	Клиент	Алынған OrderID бойынша бұрын берілген өтінім бағасының өзгеруі. Жаңа баға алдыңғыдан өзгеше болуы тиіс
4.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-7 тест. Өтінімдерді жаппай алып тастау

Тестілеу процесінде қалыптастырылған барлық қолжетімді өтінімдерді алып тастау:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	<Account> және Side = <89 және SecurityType = <0 тиісті тәртіптемесін көрсете отырып, өтінімдерді жаппай алуға сұрау салу
2.	Жүйе	Жүйе бизнес-логикаға негізделген хабарламаға жауап береді

2-8 тест. Хабарларды қайта жіберу сұрауы

Соңғы бес хабарды қайта жіберу сұрауы:

Қадам	Жіберуші	Түсініктеме
1.	Клиент	= N-5 хабардың реттік нөмірімен RetransmitRequest хабарын жіберу, мұндағы N – соңғы алынған хабардың нөмірі
2.	Жүйе	Жүйе Retransmission хабарымен және қайта сұралған хабарлармен жауап береді.

3-тест. Жіберіп алған хабарлардың көп санын қалпына келтіру**3-1 тест.** Сессияны орнату

Биржа мүшесі сауда-саттықты ұйымдастыруға және өткізуге жауапты Биржа бөлімшесінен алынған өзінің TWIME логинін көрсетіп, Recovery сервисіне қосылуы тиіс.

Биржа мүшесінің бағдарламалық қамтамасыз етуі Establish және HeartBeat (NextSeqNo = null-мен Sequence) хабарларын жіберуі тиіс. Тест автоматты түрде өтеді, арнайы әрекеттер талап етілмейді.