

KASE: ИСТОРИЯ В ЛИЦАХ



Алексей Сон:

"IT-модернизация существенно повысила конкурентоспособность KASE на рынке"

Как удалось в процессе IT-модернизации KASE без сбоев и остановок торгов перевести торги из старой торговой системы в новую торгово-клиринговую систему ASTS+, а с тестового режима перейти в рабочий или на языке профессионалов – боевой режим торгов? Причем, за относительно короткий срок модернизировать все три рынка биржи – фондовый, валютный и срочный, несмотря на вмешательство в этот процесс коронавирусной пандемии.

В этом и заключается профессионализм команды, которая смогла совершить этот перевод торгов со старых «рельсов» на «новые» так, что участники торгов на KASE сам момент перехода не ощутили, но вскоре оценили все те преимущества, которые он дал рынку. Как шел этот процесс, хорошо знает один из участников команды модернизаторов – директор Департамента торгов KASE Алексей Сон.

– Алексей, с чего началась проработка проекта, какие особенности нашего рынка и технические параметры необходимо было учесть московским партнёрам при разработке нового ПО?

– Для Казахстанской фондовой биржи – этот переход на новые торговые платформы стал по истине грандиозным проектом. Проектов таких масштабов Биржа прежде еще не реализовывала.

Изначально был проведен всесторонний анализ всех процессов в старых торговых системах, после этого нами было составлено функциональное задание, которое послужило отправной точкой в переходе на новые торговые платформы. После этого началась техническая реализация проекта специалистами MOEX.

В виду различия в законодательствах РК и РФ, а также процедур, которые уже использовались в наших прежних торговых системах, ряд функций в ASTS+ участниками проекта был либо доработан, либо создан с нуля. Например, на нашем фондовом рынке архитектура торговых счетов имеет совершенно иную структуру чем на MOEX. Также можно отметить операции РЕПО, проводимые автоматическим способом с корзиной ценных бумаг. Этого инструмента на Московской бирже не было. Третий блок отличий - система подтверждения сделок со стороны кастодианов. Этот механизм также отсутствовал на MOEX.

Поэтому эти три блока были созданы группой разработчиков абсолютно с нуля и заняли основное время разработки. На валютном рынке особых проблем с доработкой системы ASTS+ у нас не возникло. Были корректировки лишь в части операций валютного свопа. Срочный рынок также не претерпел особых доработок.

– Как велась эта работа на две страны?

– Вначале мы определили рабочую группу по запуску проекта. Сложилась довольно сильная команда – ключевые работники необходимых подразделений как со стороны KASE, так и со стороны Московской биржи.

От нашего департамента за успешную реализацию проекта отвечал в основном я и Наиль Дашаева, со стороны Департамента информационных технологий были

задействованы Куаныш Хожамбердиев, Мурат Заманов, Татьяна Остапенко и другие работники. Большая работа была проведена работниками клиринговой палаты. Со стороны Московской биржи это были – Андрей Ильин, ведущий разработчик торговых систем на фондовом и валютном рынках, Анатолий Шляпо, Андрей Логинов и другие работники, а также менеджеры данного проекта Сергей Данов и Наталья Слободчикова, которые сопровождали его с самого начала.

Мы начали с того, что перестроили свой график работы, чтобы нивелировать разницу во времени между Алматы и Москвой. Иногда приходилось задерживаться, но это не вызывало какого либо негатива со стороны нашей команды. У всех членов команды была очень сильная мотивация, даже в какой-то мере азарт – сделать и запустить такой масштабный проект, тем более что до этого никто на Бирже ничего подобного не делал.

– Кому пришлось «подвигаться» по времени?

– С первых дней у нас сложились довольно дружеские отношения с московскими коллегами. Для более эффективной работы мы использовали все возможные средства коммуникации. Если возникали какие-то срочные вопросы, мы могли просто позвонить по мобильному телефону практически в любое время, и даже если российские коллеги еще не пришли на работу, они всегда оперативно реагировали. У нас был случай, когда в 5 утра по времени Москвы потребовалась срочная консультация разработчиков. Они организовали групповой звонок и помогли решить возникшую проблему.

Основной разработчик новых торговых систем Андрей Ильин еще во времена СССР жил в Средней Азии. Ему были знакомы местная культура и обычаи. За время нашего проекта он неплохо выучил казахский язык на начальном уровне и даже мог поддержать простой диалог. Поэтому наш очередной звонок по каким-то рабочим моментам мы начинали с небольшого диалога на казахском языке: «Алеке, Қайырлы таң! Қал қалай?» и т.д. Причем инициатором изучения языка выступил сам Андрей.

– Первый этап запуска торгово-клиринговой системы на фондовом рынке шел в режиме офлайн вместе с московскими коллегами, но в дальнейший процесс вторгся COVID-19. Какие сложности в связи с этим возникли, и чем отличались эти процессы до и после?

– Для нас это были совершенно разные вызовы. Вначале специалисты MOEX предоставили нам документацию по торговой системе, которая уже работала на Московской бирже, и впоследствии была доработана под нас. Также они предоставили нам доступ к тестовым контурам, где мы попробовали совершить какие-то операции и ознакомиться с интерфейсом системы. На следующем этапе специалисты MOEX приехали к нам с рабочим визитом.

Еще до пандемии было проведено детальное обсуждение предоставленного нами функционального задания. В частности, обсуждались три основных блока: текущая архитектура торговых счетов; механизм работы автоматического РЕПО и система подтверждение сделок на фондовом рынке. Затем рабочая группа, состоящая из работников KASE, посетила Московскую биржу, где прошли встречи со специалистами MOEX. На мой взгляд, это было самым эффективным этапом в процессе нашего обучения.

В целом обучение было проведено довольно качественно. Сначала в офлайн-режиме, дальше наше обучение проводилось уже в онлайн режиме. В итоге фондовый рынок мы запустили довольно уверенно, к тому же специалисты MOEX приехали в Алматы и сопровождали процесс в течение нескольких дней от момента заключения первых сделок до их полных расчетов.

С валютным рынком ситуация была немного иная. В связи с ограничительными мерами мы запускали его самостоятельно без участия московских коллег. В связи с этим мы организовали московским коллегам удаленное подключение и настроили

видеоконференцию с ними на весь период запуска. Валютный рынок мы также мы запустились штатно.

– Возникали ли сложности у брокеров и других профучастников рынка при переходе на новые торгово-клиринговые системы и к работе ЦК?

– В основном сложности возникли со стороны участников при подключении их бэк-офисных систем к новой ASTS+ на фондовом рынке. В целом участники торгов приняли самое активное участие в тестировании и с первых же дней активно подключились к тестовым контурам. При этом многие участники попросили нас не выключать тестовый контур даже в выходные дни, потому что в рабочее время они были заняты процессами связанных с текущей операционной деятельностью. В виду того, что времени для тестирования становилось все меньше, мы предоставили им такую возможность. Накануне запуска второго релиза мы практически не выключали тестовую торговую систему на фондовом рынке. Исключением было лишь ночное время, когда работники Биржи проводили регламентные работы.

– Когда проходило тестирование тестового контура новой торговой системы, туда загружались те же данные, что были на реальном рынке?

– Для того, чтобы не раскрывать закрытую информацию, мы не переносили все данные с боевой торговой системы в тестовую, так как тестирование на стороне участника торгов мог проводить работник, который не имел доступа к такой информации. Да и к тому же это было не особо нужно. Ведь основная задача участников было – проверить подключение, провести основные торговые операции и настроить выгрузку данных в бэк-офис. Поэтому, это никак не помешало процессу тестирования.

– Были ли профучастники рынка, которые не участвовали в тестировании?

– Большая часть наших клиентов ответственно отнеслась к процессу тестирования. Может быть, одна-две компании затаили с этим процессом, но в дальнейшем они наверстали упущенное. Они понимали, что старую систему в скором времени выключат, и придется перейти в новую торговую систему. В целом освоение системы участникам понадобилось немного времени, поскольку она имеет достаточно интуитивно понятный интерфейс. В принципе, любому трейдеру, который впервые подключался к ASTS+, хватало небольшого обучения и нескольких дней, чтобы довольно уверенно пользоваться новой торговой системой.

– Но KASE сменила и протоколы передачи данных...

– Да, в старой системе биржи использовался FIX-протокол иной версии. Поэтому участникам торгов пришлось провести ряд технических работ на своей стороне. В новой торговой системе используются стандартизированные протоколы: FIX, FAST, а также нативный протокол торговой системы ASTS Bridge. Каждый протокол имеет свои преимущества и недостатки, и каждый участник, в зависимости от своих целей, выбирал нужный ему способ подключения.

– Как проходило тестирование ASTS+ для фондового рынка, и как прошел переход со старой системы на новую?

– Некоторые процессы участникам торгов пришлось выстраивать практически с нуля, например, подключении своих бэк-офисных систем посредством новых протоколов, но каких-то особых сложностей не было. Иногда возникали сложности на стороне участников торгов, связанных с непониманием документации. Для этого мы привлекали наших московских коллег.

Переход на фондовом рынке осуществлялся в два этапа. Первый этап стартовал 03 декабря 2019 года, тогда мы встречались с участниками очно. Приглашали каждую компанию на отдельную встречу, все объясняли, обсуждали какие-то моменты, отвечали на вопросы, и это позитивно повлияло на качество и скорость тестирования.

Второй этап, в августе 2020 года мы уже запускали удаленно, поскольку действовал карантин, и это заставило нас скорректировать планы по взаимодействию

с участниками торгов и клиентами и перестроить формат обучения. Если возникали вопросы, мы связывались с клиентами удаленно и объясняли, как решить проблему и конечно это немного замедляло процесс обучения и тестирования.

– Внедрение ASTS+ для валютного рынка шло уже по отработанному алгоритму?

– Как я уже сказал ранее, на валютном рынке больших доработок не было за исключением доработки в части валютного свопа и переименования некоторых полей в соответствии с нашим законодательством. Поэтому само внедрение системы оказалось намного проще, к тому же специалисты KASE и участники торгов уже были знакомы с технологиями MOEX, в виду того, что торговые системы ASTS+ на фондовом и валютном рынках очень схожи. Данный факт отразился как на обучении, так и на процессе тестирования. К тому же валютный рынок намного меньше фондового по количеству инструментов и проводимых операций.

– Пришлось ли корректировать рабочие процессы биржи в период пандемии, и как быстро сотрудники адаптировались к удаленному режиму?

– Да, конечно, нам пришлось пересмотреть график работы и некоторые бизнес процессы. В целях сохранения здоровья коллектива мы сразу ограничили все внешние контакты и часть работников перевели на удаленный режим работы. В первую очередь мы усилили контроль в части непрерывности процесса торгов и выполнения всех регламентных процедур. Остановки торгов в этот период не было. Даже во время карантина любой участник мог связываться с работниками KASE посредством телефонной связи или электронной почты и получить ответы на свои вопросы.

Весной 2020 года в связи с карантином было сокращение времени проведения торгов до 15:00, однако уже во время запуска второго этапа на фондовом рынке в августе 2020 года мы перешли к полноценному режиму. Сам же запуск второго, основного этапа на фондовом рынке прошел гладко, сбоев зафиксировано не было.

– Как быстро удалось наладить удаленный режим торгов?

– Наши IT специалисты оперативно предоставили работникам защищенное подключение к удаленным рабочим местам. Была предусмотрена обязательная персональная идентификация подключения.

В самом начале карантина мы ввели сменный режим. На случай

внештатных ситуаций в здании Биржи всегда были специалисты, которые могли подстраховать коллег, какой-то процесс перезапустить, выполнить вместо них какие-то операции. Но такие ситуации, если и возникали, то в основном по внешним причинам – у кого-то свет отключали, или были проблемы с интернетом.

– Насколько новое ПО изменило процесс работы KASE?

– Новые торговые системы гораздо технологичнее прежних во всех аспектах. Они имеют ряд неоспоримых преимуществ. В первую очередь – это возможность внедрения Центрального контрагента на всех рынках. Во-вторых, это гибкая настройка режимов торгов. Например, возможность установки расчетов в различных валютах и с различными датами расчетов. К тому же, это более удобный и дружелюбный интерфейс по отношению к пользователю с широким набором инструментария для работы трейдера. В частности, это касается гибкой настройки рабочего места под определенные задачи. Также один из основных плюсов – это возможность подключения к торговым системам посредством различных протоколов. Данная опция предоставляет большие возможности для разработчиков собственных программных продуктов участников торгов. В частности, для своих клиентов участник торгов может разработать собственное приложение и подключить его к торговой системе посредством указанных протоколов. К тому же, функционал терминала торговой системы будет избыточным для большинства клиентов участников торгов и им удобнее использовать собственное клиентское приложение.

– Как отзываются о модернизированной системе профучастники рынка, пишут ли предложения, замечания?

– Торги проходят в штатном режиме. Система показала довольно неплохую отказоустойчивость, практически все участники торгов положительно отзываются о ней. В первое время некоторые участники с раздражением относились к новому терминалу торговой системы, так как он казался им очень сложным в сравнении с прежним, но в дальнейшем практически все участники изменили свое мнение. Сейчас они в первую очередь отмечают удобный интерфейс, быстрое действие терминала и удобный поиск данных в таблицах.

До начала модернизации мы встречались с каждым участником очно, выслушивали их мнения, пожелания и постарались всех их учесть в новых торговых системах. Не скажу, что мы удовлетворили полностью все их пожелания, так как были довольно спорные моменты. После анализа таких запросов приходило понимание, что нецелесообразно делать ту или иную доработку в самой торговой системе, поскольку идею можно реализовать достаточно качественно посредством другого ПО. Например, раньше отчетность по итогам торгов мы высылали через торговую систему, но, по сути, это не функционал торговой системы. Для этого есть другие инструменты.

– Можно ли сказать, что модернизированная система KASE вошла в боевой режим?

– Безусловно. Все системы работают в штатном режиме и даже накопилась некоторая статистика, которая говорит нам о том, что система надежная. К тому же, 07 июля 2021 года мы запустили новую торговую систему на срочном рынке. Мы предоставили инструмент для участников торгов срочного рынка, теперь будем заниматься его развитием, наполнением, чтобы повысить активность на этом рынке. Попытаемся перезапустить его. В частности, будем развивать институт маркет-мейкера и проводить обучение участников торгов и их клиентов.

– Статистика торгов уже отражает перемены?

– Динамика и объемы торгов больше зависят от внешних факторов, но что касается фондового рынка, то могу сказать, что положительный эффект налицо: наблюдается значительный рост объемов торгов на денежном рынке. Во многом это произошло благодаря внедрению Центрального контрагента, который стал гарантировать расчеты по операциям автоматического РЕПО с корзинами ценных бумаг.

– Какие конкурентные преимущества получила биржа благодаря модернизации?

– Такие новации, как внедрение Центрального контрагента на всех рынках, возможность алгоритмической торговли, подключение к торговым системам посредством различных протоколов, а также общее повышение надежности и быстрого действия торговых систем существенно повысили конкурентоспособность KASE. Заложенные возможности позволяют участникам торгов, включая российских и иностранных клиентов, подключаться к нам посредством стандартных и нативных протоколов. Может быть, это будет громко сказано, но на данный момент у нас одна из лучших торговых систем в регионе.

В будущем у нас запланировано несколько крупномасштабных проектов. Это позволит нам еще больше усилить позиции на рынке. В числе проектов – внедрение клиринговых сертификатов участия, аналог операций РЕПО с корзиной. Это новый инструмент для нас, но по опросам наших клиентов он имеет неплохие перспективы. Мы надеемся, что за счет него мы еще увеличим обороты на денежном рынке.

Также мы рассматриваем переход на единый пул обеспечения. Это когда участник торгов может использовать обеспечение на различных рынках, передвигая его в реальном режиме времени между рынками. Это также большое удобство для участников торгов.

И, третье, над чем мы работаем в рамках развития срочного рынка – это прием в обеспечение на срочном рынке не только казахстанского тенге, но и других валют. Это будет очень большой плюс для зарубежных участников торгов.