

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

Утверждена

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 12 декабря 2024 года № 147)

Введена в действие

с 05 января 2025 года

ИНСТРУКЦИЯ по сертификации системы DMA

г. Алматы

2024

Инструкция по сертификации системы DMA

Настоящая Инструкция разработана в соответствии с законодательством Республики Казахстан и внутренним документом Биржи, устанавливающим условия и порядок оказания членами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) услуг по предоставлению своим клиентам прямого доступа к торговой системе Биржи, устанавливает порядок сертификации системы DMA¹.

Статья 1. Общие положения

1. Понятия, используемые в настоящей Инструкции, идентичны понятиям, определенным другими внутренними документами Биржи или законодательством Республики Казахстан.
2. Биржа проводит сертификацию системы DMA в соответствии с требованием, установленным ее внутренним документом, определяющим условия и порядок оказания членами Биржи услуг по предоставлению своим клиентам прямого доступа к торговой системе Биржи.
3. Сертификации подлежат системы DMA, применяемые для подключения к торгово-клиринговой системе Биржи посредством предоставляемых Биржей программных протоколов.
4. Система DMA для целей прохождения сертификации должна соответствовать требованиям внутреннего документа Биржи, устанавливающего требования к системам DMA членов Биржи, а также к основным условиям и порядку предоставления членами Биржи своим DMA-клиентам прямого доступа к торговой системе Биржи.

Статья 2. Сертификация системы DMA для работы с FIX-протоколом ASTS+

1. При сертификации подключения к ASTS+ по FIX-протоколу проверяется:
 - 1) успешное выставление/снятие заявок; отсутствие ошибок при постановке заявок, вызванных некорректным формированием транзакции. Для сервисов Drop Copy и Trade Capture выполнение тестов по торговым операциям не обязательно;
 - 2) корректное использование тэга 11 – ClOrdID и вместе с ним группы <Parties> (корректное выставление заявки с клиентского счета с соответствующим клиентским кодом);
 - 3) корректное использование Resend Request после восстановления сессии;
 - 4) успешное выполнение транзакций "смена пароля" (указание нового пароля в специальном поле сообщения Logon) и "смена языка ответов торговой системы" (указание языка в специальном поле сообщения Logon).
2. Для прохождения сертификации подключения через FIX-протокол член Биржи должен выполнить все описанные в приложении 1 или 2 (зависит от рынка) к настоящей Инструкции сценарии и прислать (в тот же рабочий день) на support@kase.kz получившиеся лог-файлы своей системы DMA.

¹ Согласно Правилам предоставления прямого доступа к торговой системе Биржи 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.

Статья 3. Сертификация системы DMA для работы с Bridge

1. При сертификации подключения по протоколу Bridge проверяется:
 - 1) корректность информационных запросов (открытие таблиц и их обновление);
 - 2) корректное отключение от торговой системы по завершении работы;
 - 3) отсутствие ошибок при постановке заявок, вызванных некорректным формированием транзакции;
 - 4) использование последней актуальной на момент сертификации версии шлюзового интерфейса;
 - 5) программное обеспечение обязано уметь подавать транзакцию смены пароля при работе с торговой системой, подача этой транзакции является обязательным этапом успешного прохождения сертификации;
 - 6) возможность установки ограничения на частоту запросов на получение данных.
2. Для прохождения сертификации подключения через Bridge член Биржи должен выполнить все описанные в пункте 1 настоящей статьи действия и прислать (в тот же рабочий день) на support@kase.kz получившиеся лог-файлы своей системы DMA.

Статья 4. Сертификация системы DMA для работы с FIX-протоколом SPECTRA

Для прохождения сертификации подключения через FIX-протокол член Биржи должен выполнить все описанные в приложении 3 к настоящей Инструкции сценарии и прислать (в тот же рабочий день) на support@kase.kz с пометкой “для анализа и сертификации системы DMA” получившиеся лог-файлы своей системы DMA строго в формате: Имя-сообщения (поле1=значение1, поле2=значение, ...)

Пример: 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').

Статья 5. Сертификация системы DMA для работы с TWIME-сервисом SPECTRA

Для прохождения сертификации подключения через TWIME-сервис член Биржи должен выполнить все описанные в приложении 4 к настоящей Инструкции сценарии и прислать (в тот же рабочий день) на support@kase.kz с пометкой “для анализа и сертификации системы DMA” получившиеся лог-файлы своей системы DMA строго в формате: Имя-сообщения (поле1=значение1, поле2=значение, ...)

Пример: 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').

Статья 6. Заключительные положения

1. Ответственность за своевременное внесение изменений и/или дополнений (актуализация) в настоящую Инструкцию возлагается на подразделение информационных технологий и подразделение торгов Биржи.

Инструкция по сертификации системы DMA

2. Настоящая Инструкция подлежит актуализации по мере необходимости. Настоящая Инструкция подлежит пересмотру на необходимость в актуализации не реже одного раза в 36 месяцев, исчисляемых со дня введения в действие настоящей Инструкции, а в случае ее актуализации – со дня введения в действие последних изменений/дополнений.

Председатель Правления

Алдамберген А. Ө.

Приложение 1

к Инструкции по
сертификации системы DMA

СЦЕНАРИЙ

работы системы DMA, подключающейся к FIX-протоколу ASTS+ (фондовый рынок)

Тест 1. Установка и завершение подключения

Тест 1-1. Установка сессии

Член Биржи должен подключиться к системе, указав свой SenderCompID, полученный от Биржи.

Программное обеспечение члена Биржи отправляет сообщения Logon и HeartBeat.

Тест проводится автоматически, дополнительных действий не требуется.

Ожидаемый результат: установка соединения и получение подтверждения от системы.

Тест 1-2. Завершение сессии

Член Биржи должен корректно отключиться от системы через 1 минуту.

Повторно подключиться к системе.

Ожидаемый результат: Корректное отключение и повторное подключение к системе.

Тест 2. Торговое взаимодействие

Тест 2-1. Подача заявки по ЦБ (GROSS)

Заявка принимается системой:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает лимитированную заявку на покупку тестовой акции <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со <счета>. Размер заявки – 100 акций
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-2. Проверить размещение долгосрочной заявки на продажу акции. (REPO)

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает лимитированную заявку на покупку/продажу ЦБ <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со своего счета. Режим исполнения – T+
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-3. Проверить снятие ранее размещенной заявки.

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает указание на снятие ранее размещенной заявки по ID ранее поданной заявки
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-4. Проверить подачу заявки на изменение.

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает лимитированную заявку на покупку/продажу ЦБ <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со своего счета
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике
3.	Клиент	Клиент изменяет цену ранее поданной заявки по полученному OrigCIOrdID (ID ранее поданной заявки). Новая цена должна отличаться от предыдущей
4.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-5. Запрос статуса заявки

Определение статуса заявки, поданной в тесте 2-1

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает запрос статуса заявки, выставленной в тесте 2-1, по полученному CIOrdID
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-6. Массовое снятие заявок

Снятие всех доступных заявок, сформированных в процессе тестирования:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает запрос на массовое снятие заявок, Order Mass Cancel Repor
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике. Заявки будут удалены

Приложение 2

к Инструкции по
сертификации системы DMA

С Ц Е Н А Р И Й

работы системы DMA, подключающейся к FIX-протоколу ASTS+ (валютный рынок)

Тест 1. Установка и завершение подключения

Тест 1-1. Установка сессии

Член Биржи должен подключиться к системе, указав свой SenderCompID, полученный от биржи.

Программное обеспечение члена Биржи отправляет сообщения Logon и HeartBeat.

Тест проводится автоматически, дополнительных действий не требуется.

Ожидаемый результат: Установка соединения и получение подтверждения от системы.

Тест 1-2. Завершение сессии

Член Биржи должен корректно отключиться от системы через 1 минуту.

Повторно подключиться к системе.

Ожидаемый результат: Корректное отключение и повторное подключение к системе.

Тест 2. Торговое взаимодействие

Тест 2-1. Подача заявки по ЦБ (GROSS)

Заявка принимается системой:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает лимитированную заявку на покупку тестовой валютной пары <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со <счета>
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-2. Проверить снятие ранее размещенной заявки.

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает указание на снятие ранее размещенной заявки по ID ранее поданной заявки
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-3. Проверить подачу заявки на изменение.

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает лимитированную заявку на покупку/продажу валютной пары <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со своего счета
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике
3.	Клиент	Клиент изменяет цену ранее поданной заявки по полученному OrigClOrdID (ID ранее поданной заявки). Новая цена должна отличаться от предыдущей

Инструкция по сертификации системы DMA

4.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике
----	---------	--

Тест 2-4. Запрос статуса заявки

Определение статуса заявки, поданной в тесте 2-1

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает запрос статуса заявки, выставленной в тесте 2-1, по полученному CIOrdID
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-5. Массовое снятие заявок

Снятие всех доступных заявок, сформированных в процессе тестирования:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Клиент подает запрос на массовое снятие заявок, Order Mass Cancel Repor
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике. Заявки будут удалены

Приложение 3

к Инструкции по
сертификации системы DMA

С Ц Е Н А Р И Й

работы системы DMA, подключающейся к FIX-протоколу SPECTRA

Тест 1. Установка и завершение подключения

Тест 1-1. Установка сессии

Член Биржи должен подключиться к системе, указав свой SenderCompID, полученный от подразделения Биржи, ответственного за организацию и проведение торгов.

Программное обеспечение члена Биржи должен будет послать сообщения Logon и HeartBeat. Тест проводится автоматически, специальных действий не требуется.

Тест 1-2. Завершение сессии

Член Биржи должен корректно отключиться от системы через 1 минуту и подключиться снова.

Тест 2. Торговое взаимодействие

Тест 2-1. Подача заявки на фьючерс

Заявка принимается системой:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Необходимо подать лимитированную заявку на покупку тестового фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со <счета>. Размер заявки – 5 контрактов
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-2. Размещение долгосрочной заявки на продажу фьючерса.

Нужно разместить заявку с неограниченным сроком действия:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Необходимо подать лимитированную заявку на продажу тестового фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со <счета>. Размер заявки – 6 контрактов. Режим исполнения – Good Till Date. Дата экспирации – любая
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-3. Снятие ранее поданной заявки

Размещенная (в тесте 2-2) заявка должна быть снята членом Биржи по OrigClOrdID:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подать указание на снятие ранее размещённой заявки по полученному OrigClOrdID (ClOrdID ранее поданной заявки), (продажа шести контрактов)
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Инструкция по сертификации системы DMA

Тест 2-4. Изменение заявки

Подача заявки на покупку фьючерса и изменение по OrigClOrdID:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подать лимитированную заявку на покупку фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре>. Размер заявки – 10 контрактов, со <счета>. Режим исполнения – Good Till Date. Дата экспирации – любая
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике
3.	Клиент	Изменить цену ранее поданной заявки по полученному по OrigClOrdID (ClOrdID ранее поданной заявки). Новая цена должна отличаться от предыдущей
4.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-5. Запрос статуса ордера

Определение статуса заявки, поданной в тесте 2-1

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подать запрос статуса заявки, выставленной в тесте 2-1, по полученному ClOrdID
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-6. Массовое снятие заявок

Снятие всех доступных заявок, сформированных в процессе тестирования:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подать запрос на массовое снятие заявок, указав <счет> и соответствующие режимы MassCancelRequestType=8 и MarketSegmentID=F
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике. Заявки будут удалены

Приложение 4

к Инструкции по
сертификации системы DMA

С Ц Е Н А Р И Й

работы системы DMA, подключающейся к TWIME-сервису SPECTRA

Тест 1. Установка и завершение подключения

Тест 1-1. Установка сессии

Член Биржи должен подключиться к системе, указав свой TWIME логин, полученный от подразделения Биржи, ответственного за организацию и проведение торгов.

Программное обеспечение члена Биржи должно отправить сообщение Establish и как минимум один HeartBeat (т. е. сообщение Sequence с NextSeqNo= null). Тест проходит автоматически, специальных действий пользователя не требуется.

Тест 1-2. Завершение сессии член Биржи должен корректно отключиться от системы через 1 минуту и подключиться снова.

Тест 2. Торговое взаимодействие

Тест 2-1. Подача заявки на фьючерс

Подача заявки со сроком действия "день":

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подача лимитированной заявки на покупку фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре>. Размер заявки – 5 контрактов со <счета>. Вид заявки – Day <0>
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-2. Подача длинной заявки на покупку фьючерса.

Подача заявки с ограниченным сроком действия:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подача лимитированной заявки на покупку фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре> с ценой <вписывающейся в лимиты> со <счета>. Размер заявки – 6 контрактов. Режим исполнения GTD=<6>. Дата экспирации – любая, отличная от текущей
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-3. Снятие ранее поданной заявки

Поданная (в тесте 2-1 или 2-2) заявка должна быть снята членом Биржи по OrderID:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подача приказа на снятие ранее поданной заявки по полученному OrderID, (продажа шести контрактов)
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-5. Изменение заявки

Выставление заявки на покупку фьючерса и изменение выставленной заявки:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подача лимитированной заявки на покупку фьючерса <любой из доступных на тестовом контуре>. Размер заявки – 10 контрактов, со <счета>). Вид заявки – Day <0>
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике
3.	Клиент	Изменение цены ранее поданной заявки по полученному OrderID. Новая цена должна отличаться от предыдущей
4.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-7. Массовое снятие заявок

Снятие всех доступных заявок, сформированных в процессе тестирования:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Подача запроса на массовое снятие заявок, указав <Account> и соответствующий режим Side= <89> и SecurityType=<0>
2.	Система	Система отвечает сообщением, основанным на бизнес-логике

Тест 2-8. Запрос повторной пересылки сообщений

Запрос повторной пересылки пяти последних сообщений:

Шаг	Отправитель	Комментарий
1.	Клиент	Отправка сообщения RetransmitRequest с порядковым номером сообщения =N-5, где N – номер последнего полученного сообщения
2.	Система	Система отвечает сообщением Retransmission и перезапрошенными сообщениями.

Тест 3. Восстановление большого количества пропущенных сообщений

Тест 3-1. Установка сессии

Член Биржи должен подключиться к Recovery сервису, указав свой TWIME логин, полученный от подразделения Биржи, ответственного за организацию и проведение торгов.

Программное обеспечение члена Биржи должно отправить сообщения Establish и HeartBeat (Sequence с NextSeqNo=null). Тест проходит автоматически, специальных действий не требуется.