



Торговая система "Терминал для торговли и расчетов
ценными бумагами в валюте".

Версия 1.1

**РУКОВОДСТВО ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ
СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ
СИСТЕМЫ "ТЕРМИНАЛ ДЛЯ
ТОРГОВЛИ И РАСЧЕТОВ ЦЕННЫМИ
БУМАГАМИ В ВАЛЮТЕ"**

г. Алматы

2018

СОДЕРЖАНИЕ

СОДЕРЖАНИЕ.....	2
ВВЕДЕНИЕ	3
ГЛАВА 1. УСТАНОВКА И ПОДКЛЮЧЕНИЕ	3
1.1. СИСТЕМНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ	3
1.2. УСТАНОВКА КЛИЕНТСКОГО ПРИЛОЖЕНИЯ СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ	3
1.3. ОБНОВЛЕНИЕ РАБОЧЕГО МЕСТА СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ	4
1.4. УСЛОВИЯ ПОДКЛЮЧЕНИЯ ПОЛЬЗОВАТЕЛЕЙ К СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ	4
1.5. ПОДКЛЮЧЕНИЕ К СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ	4
ГЛАВА 2. РАБОЧАЯ СРЕДА СПЕЦИАЛЬНОЙ ВЕРСИИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ	6
2.1. ПОДАЧА ЗАЯВОК	7
2.1.1. РЕПО С НЕТТИНГОМ.....	8
2.2. ПРОВЕДЕНИЕ РАСЧЕТОВ	8
2.3. ПОЛУЧЕНИЕ БИРЖЕВЫХ СВИДЕТЕЛЬСТВ	9

Введение

В рамках внедрения механизма заключения сделок с евронотами, номинированными в иностранной валюте, в валюте номинации, АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) была разработана специальная версия торговой системы Биржи – "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте". Специальная версия торговой системы (далее – "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте") является отдельной версией основной торговой системы Биржи. "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте" имеет интерфейс, схожий с интерфейсом основной торговой системы. При этом в торговой системе для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте имеются следующие отличительные особенности:

- сокращен список финансовых инструментов, доступных пользователю;
- повышены функциональные характеристики системы в части поддержки большого количества торговых счетов, заявок и сделок;
- добавлены дополнительные объекты.

Глава 1. Установка и подключение

1.1. Системные требования

Для установки клиентского приложения торговой системы для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте (далее – терминал "KASE TERMINAL USD") требуется обеспечение параметров рабочей станции пользователя аналогичными параметрами, требуемыми для установки основной торговой системы которые должны соответствовать следующим минимальным характеристикам:

- процессор Intel Pentium 4 или совместимый с тактовой частотой от 2 ГГц;
- оперативная память – 1 Гб, свободное место на жестком диске – 100 Мб;
- разрешение экрана от 1024x768 с глубиной цвета от 32 бит;
- клавиатура, мышь;
- пропускная способность канала связи на каждое рабочее место:
 - при подключении по прямому каналу связи или через провайдера – от 128 кбит/с;
 - при подключении через сеть Интернет по выделенному соединению – не менее 256 кбит/с;
- операционная система Microsoft Windows XP или более поздняя версия.

1.2. Установка клиентского приложения специальной версии торговой системы

1. Для установки терминала для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте необходимо скачать дистрибутив "**KASE terminal USD**" с официального сайта Биржи по ссылке <http://www.kase.kz/downloads>.
2. Для запуска мастера установки следует дважды щелкнуть значок сохраненного файла, при этом появится окно "**Installing KASE terminal USD**" соответствующей версии. После этого необходимо следовать инструкциям мастера установки.
3. При установке терминала лог-файлы терминала, файлы для обмена информацией с внешними системами и конфигурационные файлы сохраняются в локальном каталоге <Локальный диск>: \Users\\AppData\Local\KASE Terminal USD.

4. По окончании установки на рабочем столе отображается ярлык для запуска установленного терминала – **"KASE terminal USD"**.

1.3. Обновление рабочего места специальной версии торговой системы

Проверка наличия новой версии терминала осуществляется автоматически во время каждой процедуры запуска терминала посредством ярлыка **"KASE terminal USD"**. При наличии соответствующего обновления его загрузка производится в автоматическом режиме.

1.4. Условия подключения пользователей к специальной версии торговой системы

Вход пользователя в торговую систему "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте" требует наличие токена, персонального идентификационного номера и пароля доступа, который используется в основной торговой системе Биржи.

Примечание В специальной версии торговой системы "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте" пользователем используется логин и пароль, предназначенные для доступа к основной торговой системе.

Допускается одновременный запуск и использование на одной рабочей станции специальной версии торговой системы для расчетов в валюте и основной торговой системы с использованием одних и тех же логина и пароля.

Изменение пароля к токenu с ключевой информацией осуществляется только путем генерации токена в основной торговой системе.

Внимание! В случае изменения пользователем пароля в основной торговой системе путем генерации токена с ключевой информацией вход под этим токеном в специальную версию торговой системы возможен только в день, следующий за днем произведенной генерации.

1.5. Подключение к специальной версии торговой системы

При запуске терминала автоматически появляется диалоговое окно **"Регистрация"**, в котором необходимо ввести персональный идентификационный номер ID и персональный пароль, используемые в основной торговой системе.

Внимание! Будьте внимательны при вводе пароля. В диалоговом окне пароль отображается в виде скрытых символов.

Ошибки при переключении между прописными и строчными буквами, а также раскладками клавиатуры, могут привести к вводу неверного пароля и к отказу в регистрации в торговой системе. ID пользователя может быть введен только латинскими буквами с использованием английской раскладки клавиатуры. При неверном вводе пароля более трех раз токен с ключевой информацией блокируется. После этого вход в торговую систему "Подписка" и основную торговую систему также будет заблокирован.

Для работы с торговой системой "Терминал для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте" применяются следующие виды соединений с ее сервером:

- 1) **192.168.111.89** (соединение посредством выделенного канала);
- 2) **212.19.144.89** (соединение посредством Интернета);
- 3) **31.31.217.211** (резервное соединение посредством Интернета);

Порт **1537**.

Пользователю предоставляется выбор одного из видов соединения с сервером торговой системы в окне "**Параметры соединения**", которое можно открыть двумя способами:

- 1) через окно "**Регистрация**" путем нажатия кнопки "**Setting**";
- 2) через меню "**Соединение**" главного меню.

При переходе в режим выбора вида соединения появляется окно "**Параметры соединения**". При этом соединение с сервером торговой системы "Подписка" прерывается автоматически.

Параметры соединения

Боевая система | Тестовая система | Прокси сервер | Параметры ключа

Сервер: 192.168.111.89 212.19.144.89 31.31.217.211

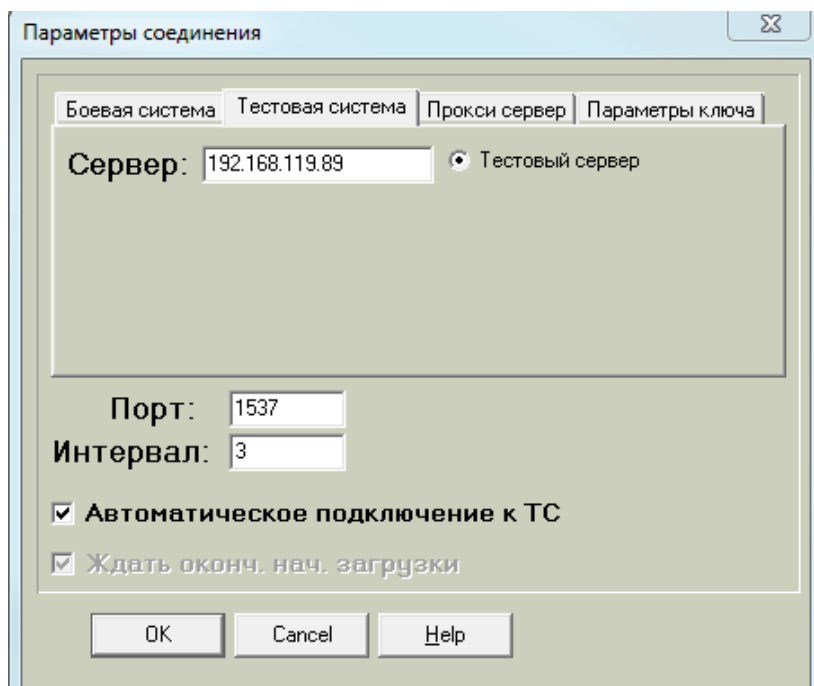
Основной - выд. линия, VPDN
Основной - интернет
Основной - резервный интернет
Резервный сервер - интернет
Резервный сервер - выд. линия

Порт: 1537
Интервал: 3

Автоматическое подключение к ТС
 Ждать оконч. нач. загрузки

OK Cancel Help

Посредством окна "**Параметры соединения**" доступна возможность выбора соединения с тестовой версией торговой системы для ознакомления с ее работой.



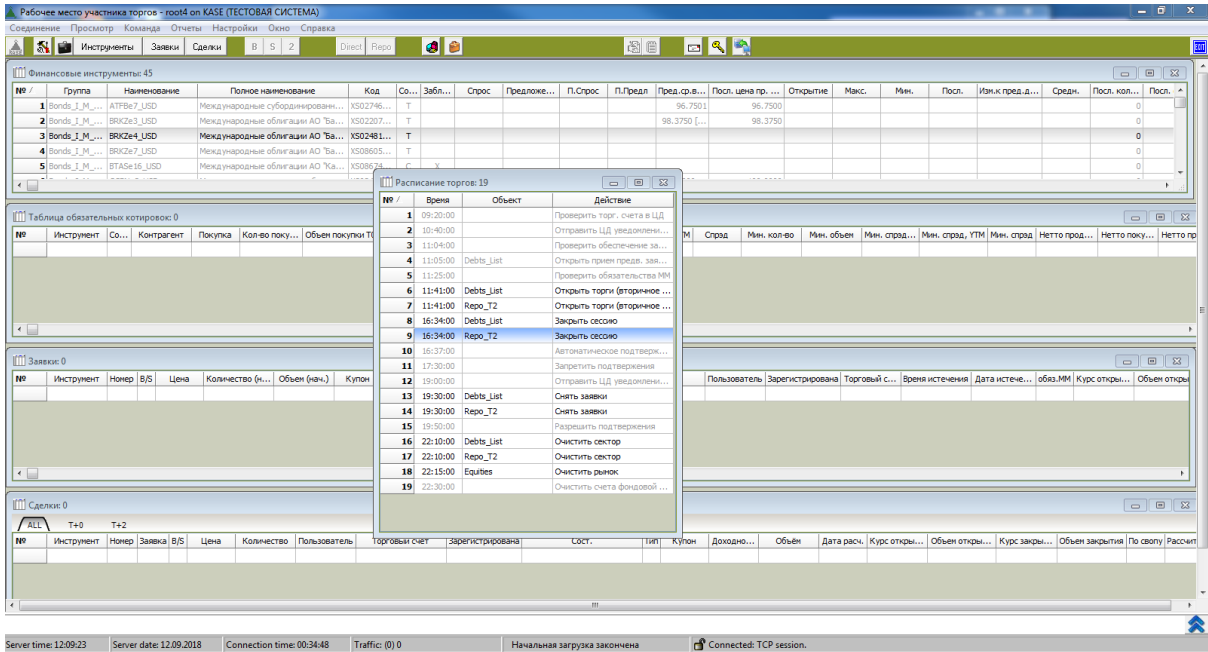
После выбора типа соединения с сервером торговой системы "Терминал для расчетов в валюте" на экране терминала пользователя вновь появляется окно "Регистрация", в редактируемых полях которого необходимо повторно указать ID и пароль.

Внимание! В целях идентификации тестовой версии торговой системы, просьба при работе с ней обращать внимание на заголовок окна рабочего места участника торгов.

Рабочее место участника торгов - root4 on KASE (ТЕСТОВАЯ СИСТЕМА)

Глава 2. Рабочая среда специальной версии торговой системы

Рабочий стол участника торговой системы для торговли и расчетов ценными бумагами в валюте отличается от основной торговой системы цветом в целях минимизации ошибок.



Участникам доступны все функции основной торговой системы Биржи.

2.1. Подача заявок

Заявки подаются через стандартную форму подачи заявки. Объем заявки рассчитывается торговой системой с учетом накопленного интереса на день T+2.

The 'Ввод новой заявки' (New Order Entry) form is shown for the instrument BRKZe3_USD. The trading account is set to [redacted].

Направл.: Покупка Продажа

Тип заявки: Лимитированная Рыночная

Отклонение цены: от последнего значения от средней взвешенной цены более чем на 0% (код 1003)
min (98.3750) max (98.3750)

Цена: 98.0000 **Количество:** 1 000

Доходность, %: 7.7899 **Объем:** 997.69

Время истечения: [] : [] **Дата истечения:** [] . [] . []

Обязательная котировка ММ Автомат

Устанавливать периодически заявки: в указанных ценах в указанных доходностях

Buttons: Купить, Отмена, Справка

2.1.1. Репо с неттингом

В специальной версии торговой системы для расчетов в валюте также доступны инструменты автоматического репо без блокировки залогового инструмента, в свойствах которых отмечен признак "Репо с неттингом". Торги открытые, проводятся методом непрерывного встречного аукциона, ранжирование по цене обратное. Срок операции репо не может быть изменен участником, задается в свойствах инструмента. В заявке репо с неттингом объем открытия рассчитывается с учетом накопленного интереса на текущий день.

2.2. Проведение расчетов

Расчеты по заключенным сделкам проводятся в долларах США (статус сделки "Wait for Clearing") ежедневно после закрытия торгов с 17.00 до 17.40.

№ /	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована	Сост.	Тип	Купон	Доходно...	Объём	Дата расч.
1	BRKZe3_USD	13	65	S	98.3750	1	-	-	13.09.2018 14:...	Wait for Clearing		1.8778	7.5205	1.00	17.09.2018
2	BRKZe3_USD	13	64	B	98.3750	1	-	-	13.09.2018 14:...	Wait for Clearing		1.8778	7.5205	1.00	17.09.2018

На второй день после заключения сделок Клиринговая палата Биржи производит клиринг и на основании обязательств и требований формирует расчетную ведомость, которая отправляется на расчеты в Центральный депозитарий (статус сделки "Waits for CD") с 17.30 до 18.00.

№	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована	Сост.	Тип	Купон	Доходно...	Объём	Дата расч.
10	RN_BRKZe3...	12	55	B	1.0617	10 000	-	-	10.09.2018 17:...	Waits for CD	RC		3.4382	10 617.00	11.09.2018
9	RN_BRKZe3...	12	54	S	1.0617	10 000	-	-	10.09.2018 17:...	Waits for CD	RC		(3.4382)	10 617.00	11.09.2018
3	CCBNe3_USD	7	32	S	100.0000	1 000	-	-	08.09.2018 13:...	Waits for CD		0.1854	8.3411	1 001.85	11.09.2018
4	CCBNe3_USD	7	31	B	100.0000	1 000	-	-	08.09.2018 13:...	Waits for CD		0.1854	8.3411	1 001.85	11.09.2018

Внимание! В день расчетов участнику торгов, заключившему сделку, необходимо иметь на торговом счете 100% обеспечения для проведения успешных расчетов. В случае отсутствия активов в день расчетов участнику торгов доступны операции репо с неттингом для переноса его позиций.

После успешного проведения расчетов статус сделок меняется на **"Done"**.

Сделки: 10															
ALL T+0 T+2															
№	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована	Сост.	Тип	Купон	Доходно...	Объем	Дата расч.
10	RN_BRKZe3...	12	55	B	1.0617	10 000	-	-	10.09.2018 17:...	Done	RC		3.4382	10 617.00	11.09.2018
9	RN_BRKZe3...	12	54	S	1.0617	10 000	-	-	10.09.2018 17:...	Done	RC		(3.4382)	10 617.00	11.09.2018
3	CCBNe3_USD	7	32	S	100.0000	1 000	-	-	08.09.2018 13:...	Done		0.1854	8.3411	1 001.85	11.09.2018
4	CCBNe3_USD	7	31	B	100.0000	1 000	-	-	08.09.2018 13:...	Done		0.1854	8.3411	1 001.85	11.09.2018

2.3. Получение биржевых свидетельств

Биржа формирует два биржевых свидетельства по каждому члену Биржи: в день заключения сделки и после завершения всех расчетов с 18.00 до 19.00.

Внимание! Получение биржевого свидетельства по сделкам, заключенным в специальной версии торговой системы, осуществляется посредством основной торговой системы.