



Торговая система. Версия 2.52

РУКОВОДСТВО ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ

г. Алматы

2018

Содержание

ВВЕДЕНИЕ	6
ГЛАВА 1. УСТАНОВКА И ОБНОВЛЕНИЕ РАБОЧЕГО МЕСТА.....	7
1.1. СИСТЕМНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ	7
1.2. УСТАНОВКА КЛИЕНТСКОГО ПРИЛОЖЕНИЯ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ БИРЖИ.....	7
1.3. ОБНОВЛЕНИЕ РАБОЧЕГО МЕСТА.....	8
1.4. УСЛОВИЯ ПОДКЛЮЧЕНИЯ ПОЛЬЗОВАТЕЛЕЙ К ТОРГОВОЙ СИСТЕМЕ БИРЖИ.....	8
ГЛАВА 2. ПОДКЛЮЧЕНИЕ К ТОРГОВОЙ СИСТЕМЕ БИРЖИ	9
2.1. РЕГИСТРАЦИЯ В ТОРГОВОЙ СИСТЕМЕ БИРЖИ.....	9
2.2. ВЫБОР ТИПА СОЕДИНЕНИЯ.....	10
ГЛАВА 3. ИНТЕРФЕЙС РАБОЧЕГО МЕСТА ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ	12
3.1. ФУНКЦИИ ГЛАВНОГО МЕНЮ ПРОГРАММЫ.....	12
3.1.1. МЕНЮ "СОЕДИНЕНИЕ"	12
3.1.2. МЕНЮ "ПРОСМОТР"	14
3.1.3. МЕНЮ "ДЕЙСТВИЯ"	15
3.1.4. МЕНЮ "ОТЧЕТЫ"	15
3.1.5. МЕНЮ "НАСТРОЙКИ"	16
3.1.6. МЕНЮ "ОКНО".....	18
3.1.7. МЕНЮ "СПРАВКА"	18
3.2. СТРОКА УПРАВЛЕНИЯ.....	18
3.3. РАБОЧИЙ СТОЛ ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ.....	19
НАВИГАЦИОННАЯ ПАНЕЛЬ.....	21
3.4. СТРОКА СОСТОЯНИЯ.....	22
3.5. ГЛАВНОЕ ОКНО РАБОЧЕГО МЕСТА ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ.....	22
ГЛАВА 4. СТРУКТУРА ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ БИРЖИ	23
4.1. РЫНКИ.....	23
4.2. СЕКТОР РЫНКА.....	24
4.3. ГРУППЫ ИНСТРУМЕНТОВ.....	28
4.4. ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ.....	30
4.5. ИЗБРАННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ	39
4.6. ИСТОРИЯ ТОРГОВ	41
4.7. ОРГАНИЗАЦИИ.....	42
4.8. ФИРМЫ.....	43
4.9. ПОЛЬЗОВАТЕЛИ	44

4.10.	ТОРГОВЫЕ СЧЕТА	48
4.11.	ПОЗИЦИОННЫЕ СЧЕТА	49
4.11.1.	ИЗМЕНЕНИЕ ПОЗИЦИОННЫХ СЧЕТОВ	52
4.12.	ЗАГРУЗКА ДЕНЕЖНЫХ ПОЗИЦИЙ С ПОМОЩЬЮ XML-ФАЙЛА	60
4.13.	ЗАЯВКИ	62
4.13.1.	АКТИВНЫЕ ЗАЯВКИ	62
4.13.2.	НЕАКТИВНЫЕ ЗАЯВКИ.....	65
4.13.3.	ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫЕ ЗАЯВКИ.....	66
4.13.4.	ДВОЙНЫЕ ЗАЯВКИ.....	66
4.13.5.	ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫЕ ПЕРИОДИЧЕСКИЕ ДВОЙНЫЕ ЗАЯВКИ	68
4.14.	СДЕЛКИ	70
4.15.	КОТИРОВКИ.....	75
4.16.	ПРЯМЫЕ КОТИРОВКИ.....	76
4.17.	РЕПО-ОБЯЗАТЕЛЬСТВА.....	78
4.17.1.	КОМПЕНСАЦИОННЫЕ ПЛАТЕЖИ	80
4.18.	ТРАНЗИТНЫЕ ПРИКАЗЫ	81
4.19.	ТАБЛИЦА ОЦЕНОЧНЫХ ЦЕН	83
4.20.	ТАБЛИЦА "ПАРАМЕТРЫ ГРУПП".....	84
4.21.	ТАБЛИЦА ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ КОТИРОВОК	85
4.22.	РАСПИСАНИЕ ТОРГОВ	88
4.23.	ДЕПОЗИТАРИЙ.....	90
4.24.	ВАЛЮТЫ	91
4.25.	СООБЩЕНИЯ	92
4.26.	СИСТЕМНАЯ ИНФОРМАЦИЯ	93
4.27.	СИСТЕМА ПОДТВЕРЖДЕНИЯ	94
4.28.	ИСТОРИЯ ЗАЧИСЛЕНИЙ/СПИСАНИЙ.....	99
ГЛАВА 5. ПРАВА.....		99
5.1.	ПРАВА ФИРМЫ	99
5.2.	ПОЛЬЗОВАТЕЛИ	100
ГЛАВА 6. ТОРГИ.....		103
6.1.	ОПИСАНИЕ ПРЕДУПРЕЖДЕНИЙ ВВОДА НОВОЙ ЗАЯВКИ	103
6.2.	МЕТОД ОТКРЫТЫХ ТОРГОВ.....	107
6.3.	МЕТОД ПРЯМЫХ ТОРГОВ.....	110
6.4.	МЕТОД СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫХ ТОРГОВ.....	110

6.4.1.	ПРОВЕДЕНИЕ СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫХ ТОРГОВ С ПРОПОРЦИОНАЛЬНЫМ УДОВЛЕТВОРЕНИЕМ.....	111
6.5.	МЕТОД ФРАНКФУРТСКИХ ТОРГОВ	111
6.5.1.	ПРЕДОТВРАЩЕНИЕ МАНИПУЛЯЦИЙ ЦЕНАМИ (РЕЖИМ ОЖИДАНИЯ).....	112
6.5.2.	ПРОВЕДЕНИЕ ФРАНКФУРТСКИХ ТОРГОВ ПРИ РАЗМЕЩЕНИИ ИЛИ ВЫКУПЕ	114
6.6.	МЕТОД ФИКСИНГА.....	114
ГЛАВА 7. РЫНОК РЕПО		115
7.1.	ПРЯМОЕ РЕПО	115
7.2.	ИЗМЕНЕНИЕ ПАРАМЕТРОВ СДЕЛОК ЗАКРЫТИЯ РЕПО	116
7.2.1.	ПЕРЕОЦЕНКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	118
7.3.	"АВТОМАТИЧЕСКОЕ" РЕПО	124
7.4.	РЕПО С НЕТТИНГОМ.....	126
ГЛАВА 8. РЫНОК ВЕКСЕЛЕЙ.....		133
8.1.	ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК.....	133
ГЛАВА 9. СРОЧНЫЙ РЫНОК.....		133
9.1.	УСЛОВИЯ ДОСТУПА К ТОРГАМ СРОЧНЫМИ КОНТРАКТАМИ	133
9.2.	ПРОЦЕДУРА ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ.....	135
9.3.	НЕИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	139
9.4.	СЛУЧАИ ПРИОСТАНОВКИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ	141
ГЛАВА 10. ЭЛЕКТРОННЫЙ ДОКУМЕНТООБОРОТ.....		141
10.1.	ЭЛЕКТРОННАЯ ЦИФРОВАЯ ПОДПИСЬ	141
10.2.	ПОЛУЧЕНИЕ ЭЛЕКТРОННЫХ ДОКУМЕНТОВ С СЕРВЕРА ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ БИРЖИ	142
10.3.	ПРОСМОТР И ПЕЧАТЬ ЭЛЕКТРОННЫХ ДОКУМЕНТОВ	144
10.4.	ПРОВЕРКА ПОДЛИННОСТИ ЭЛЕКТРОННОГО ДОКУМЕНТА ...	145
10.5.	ПОЛУЧЕНИЕ ОТЧЕТОВ ПО СДЕЛКАМ.....	146
10.6.	СОВМЕСТИМОСТЬ С ПРЕДЫДУЩИМИ ВЕРСИЯМИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ БИРЖИ.....	147
ГЛАВА 11. РАБОТА С ГРАФИКАМИ.....		147
11.1.	РАБОТА С ГРАФИКАМИ	147
11.2.	ВЫБОР ГРАФИКА.....	147
11.3.	ПОСТРОЕНИЕ ГРАФИКОВ ПРЕДЫДУЩИХ ТОРГОВЫХ СЕССИЙ	148
ПРИЛОЖЕНИЕ 1 К РУКОВОДСТВУ ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ		149

КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ МЕТОДОВ ТОРГОВ.....	149
МЕТОД НЕПРЕРЫВНОГО ВСТРЕЧНОГО АУКЦИОНА.....	149
МЕТОД ЗАКЛЮЧЕНИЯ ПРЯМЫХ СДЕЛОК.....	149
МЕТОД СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫХ ТОРГОВ.....	150
МЕТОД ФРАНКФУРТСКИХ ТОРГОВ.....	150
МЕТОД ФИКСИНГА.....	151
ПРИЛОЖЕНИЕ 2 К РУКОВОДСТВУ ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ.....	152
ОСНОВНЫЕ СТАНДАРТНЫЕ, СПЕЦИАЛЬНЫЕ И "ГОРЯЧИЕ" КЛАВИШИ.....	152
1. СТАНДАРТНЫЕ КЛАВИШИ.....	152
2. СПЕЦИАЛЬНЫЕ КЛАВИШИ.....	152
3. "ГОРЯЧИЕ" КЛАВИШИ.....	153

Введение

Торговая система акционерного общества "Казахстанская фондовая биржа" (именуемого в дальнейшем "Биржа") – это комплекс материально-технических средств, внутренних документов Биржи и иных необходимых активов и процедур, с использованием которых между членами Биржи заключаются сделки с эмиссионными ценными бумагами и иными финансовыми инструментами.

Торговая система Биржи разработана специалистами Биржи для организации электронных торгов различными финансовыми инструментами. 12 февраля 1998 года в торговой системе Биржи были проведены первые торги.

Основные характеристики торговой системы Биржи:

- идеология – "клиент-сервер";
- серверная часть написана на языке программирования C++, работает на платформе Linux. Linux платформа предоставляет аппаратную независимость в выборе серверного оборудования;
- клиентская часть – рабочее место участника торгов работает на платформе Win32, написана на языке программирования C++ Builder version 5.0;
- протокол обмена сообщениями – TCP/IP;
- система защищена от временных сбоев в энергоснабжении двумя источниками бесперебойного питания мощностью 20 кВт каждый;
- для хранения данных и управления ими требуется использование SQL сервера – реляционной СУБД типа Informix, Oracle.

Торговая система Биржи является гибким и настраиваемым модулем под использование различных финансовых инструментов.

Настоящее Руководство предназначено в качестве пособия по изучению основных функций и особенностей работы с программным обеспечением рабочего места пользователя торговой системы Биржи.

Настоящее Руководство носит рекомендательный и разъяснительный характер.

Настоящее Руководство не предполагает обучение пользователей работе в графической среде Windows.

Глава 1. Установка и обновление рабочего места

1.1. Системные требования

- процессор Intel Pentium 4 или совместимый с тактовой частотой от 2 ГГц;
- оперативная память 1 Гб, свободное место на 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 к торговой системе Биржи по прямому каналу связи или через провайдера – от 128 кбит/с
 - при подключении к торговой системе Биржи через сеть Интернет по выделенному соединению – не менее 256,0 кбит/с
- операционная система Microsoft Windows XP или более поздней версии;
- Microsoft Internet 5.5 или более поздней версии.

1.2. Установка клиентского приложения торговой системы Биржи

1. Для установки клиентского приложения торговой системы Биржи (далее - терминал) необходимо скачать дистрибутив терминала с официального сайта www.kase.kz (или по ссылке http://kase.kz/ru/kase_connection).
2. Дважды щелкните значок сохраненного файла, чтобы запустить мастера установки. При этом появится окно **"Installing KASE terminal"** соответствующей версии, в котором необходимо пошагово выполнять все требуемые условия.
3. Если другие версии терминала ранее не устанавливались, терминал по умолчанию устанавливается в папку <Локальный диск>:\Program Files\KASE Terminal на системном диске.

Чтобы изменить папку для установки терминала, нажмите кнопку **"Выбор"**. Появится стандартное окно **"Обзор папок"**, в котором можно выбрать или создать папку для установки. Подтвердив выбор папки, нажмите кнопку **"Начать"** для запуска процесса установки терминала на локальном компьютере.

При установке торговой системы лог-файлы торговой системы, файлы для обмена информацией с внешними системами и конфигурационные файлы торговой системы сохраняются в локальном каталоге <Локальный диск>:\Users\<Username>\AppData\Local\KASE Terminal.

Внимание! Перед обновлением торговой системы пользователю необходимо сохранить копию файла **KASE.ini** для переноса пользовательских настроек (отображение окон, столбцов и т.д.). По умолчанию файл находится в папке <Локальный диск>:\Program Files\KASE terminal. После обновления системы необходимо перенести предварительно сохраненный файл **KASE.ini** в каталог: <Локальный диск>:\Users\ <Username>\ AppData\ Local\ KASE Terminal (рабочий каталог Терминала версии 2.38).

4. По окончании установки на рабочем столе отображается ярлык для запуска установленного клиентского приложения.

Внимание! При очистке реестра расположение окон на экране терминала пользователя и другие индивидуальные настройки пользователя НЕ сохраняются!

Примечание При удалении терминала торговой системы Биржи либо его настроек требуется выйти из него.

1.3. Обновление рабочего места

Проверка наличия новой версии терминала торговой системы Биржи происходит автоматически во время каждой процедуры запуска торговой системы Биржи. При наличии соответствующего обновления его загрузка происходит автоматически.

В целях стабильной работы терминала и доступности всех ее функций настоятельно рекомендуется устанавливать все предлагаемые обновления.

1.4. Условия подключения пользователей к торговой системе Биржи

Вход пользователя в торговую систему Биржи требует наличия у него:

1. персонального идентификационного номера для допуска к пользованию торговой системой Биржи (**ID**), который:
 - присваивается маклером Биржи
 - используется многократно
 - может быть заменен только маклером Биржи;

Исключение ID пользователя, являющегося клиентом (работником клиента) члена Биржи, присваивается этим членом Биржи самостоятельно, используется многократно и может быть заменен этим членом Биржи или маклером Биржи.

2. пароля доступа в торговую систему Биржи (пароля).

Первоначальный пароль:

- пользователь получает на Бирже;
- используется единожды в целях его замены на собственноручно генерируемый пользователем пароль при его первом входе в торговую систему Биржи.

Персональный пароль по желанию пользователя может быть самостоятельно изменен. Информация о порядке смены пароля пользователем приведена в пункте **"Меню "Соединение"**.

Пользователь несет всю ответственность за последствия передачи пароля третьим лицам, поскольку безопасность работы обеспечивается его сохранностью;

3. токена или файла с ключевой информацией (только при применении **SSL-соединения**).

В качестве токена используется специальное устройство хранения информации с энергонезависимой памятью, подключаемое к USB-порту компьютера, который удобен для работы ввиду его размера и технических возможностей и обеспечивает безопасность хранения ключевой информации.

Файл с ключевой информацией хранится на жестком диске пользователя. Для работы с файлом необходимо указать его расположение. Выбранное расположение сохраняется в конфиг-файле терминала.

Для работы с торговой системой Биржи токен с ключевой информацией вводится в USB-порт непосредственно или через кабель-удлинитель.

Примечание Программное обеспечение терминала пользователя допускает извлечение токена из устройства чтения сразу после регистрации пользователя в терминале.

Внимание! Для работы с терминалом торговой системы Биржи и использованием токена с ключевой информацией, необходимо установить драйвер (ikeydrv.exe), который можно скачать с официального сайта www.eTrade.kz (или по ссылке <http://www.etrade.kz/downloads>)

Первоначальная ключевая информация:

- генерируется Биржей;
- используется пользователем единожды для генерации своих собственных ключей и получения нового сертификата открытого ключа от Центра сертификации.

Генерация новых ключей с получением нового сертификата открытого ключа от Центра сертификации может быть произведена пользователем самостоятельно в любой момент его работы с торговой системой Биржи.

Глава 2. Подключение к торговой системе Биржи

2.1. Регистрация в торговой системе Биржи

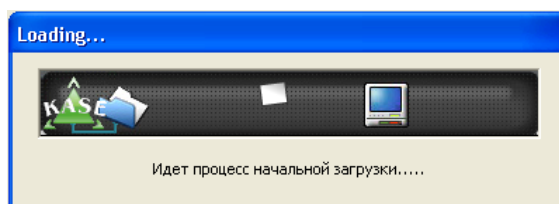
При запуске терминала автоматически появляется диалоговое окно **"Регистрация"**, в котором необходимо ввести персональный идентификационный номер – ID и персональный пароль. ID пользователя – имя пользователя в торговой системе Биржи.

Внимание! Будьте внимательны при вводе пароля. В диалоговом окне символы пароля отображаются звездочками (*). Ошибки при переключении между прописными и строчными буквами, а также текущая раскладка клавиатуры (английская или русская) могут привести к вводу неверного пароля и к отказу в регистрации в торговой системе Биржи. ID пользователя может быть введено только латинскими буквами с английской раскладки клавиатуры. При неверном вводе пароля более трех раз токен с ключевой информацией блокируется.

При включении опции **"Не подключать инструменты"** уменьшается время начальной загрузки, а необходимые финансовые инструменты пользователь может подключить в процессе дальнейшей работы с торговой системой Биржи. По умолчанию данная опция выключена.

При нажатии кнопки **"Settings"** соединение с сервером торговой системы Биржи прерывается автоматически. Далее происходит переход в режим выбора соединения. Более подробно действия по выбору соединения описаны в пункте **"Выбор типа соединения"**.

После успешного прохождения регистрации требуется определенное время для начальной загрузки, свидетельством которого является появление на экране терминала пользователя окна **"Процесс начальной загрузки"**.



Начальная загрузка может занимать от одной-двух до пяти минут в зависимости от качества канала связи пользователя с сервером и объема доступной пользователю информации.

Внимание! До окончания начальной загрузки каких-либо действий в торговой системе Биржи предпринимать не рекомендуется.

Далее на экране терминала пользователя появляются окна в соответствии с настройками данного пользователя.

По умолчанию при первом подключении пользователя к торговой системе Биржи на экране терминала автоматически откроются шесть окон: **"Финансовые инструменты"**, **"Избранные финансовые инструменты"**, **"Таблица обязательных котировок"**, **"Заявки"**, **"Предварительные периодические заявки"**, **"Сделки"**.

При последующих подключениях по завершении начальной загрузки на экране терминала пользователя будут отображены окна в соответствии с их первоначальной настройкой или в соответствии с ранее сохраненными настройками пользователя¹.

Свидетельством окончания начальной загрузки служит появление в поле **"Traffic"** информации о нулевом объеме полученной информации. Индикатором успешного постоянного соединения с сервером служат сообщение строки состояния **"Connected"**, а также меняющиеся значения полей **"Server time"**, **"Connection time"** и **"Traffic"**. При разрыве связи с Сервером указанные поля становятся пустыми, и выводится мигающее сообщение **"DISCONNECTED"**, выделяемое красным цветом фона строки состояния.

Дополнительная информация о регистрации в торговой системе Биржи приведена в пункте **"Меню "Соединение"**.

Для завершения работы с торговой системой Биржи и закрытия рабочего места нажмите кнопку **"Exit"** в строке управления.

Внимание! В случае длительного ожидания ответа с сервера в системе отображается модальное окно "Обработка операции, пожалуйста, подождите", которое не позволяет пользователю совершать какие-либо действия в системе, до тех пор, пока соединение с сервером не будет восстановлено.

2.2. Выбор типа соединения

Для работы с торговой системой Биржи применяются следующие типы соединений с ее сервером:

- **SSL-соединение** (с использованием программно-криптографических средств защиты информации);
- **TCP-соединение** (без использования программно-криптографических средств защиты информации).

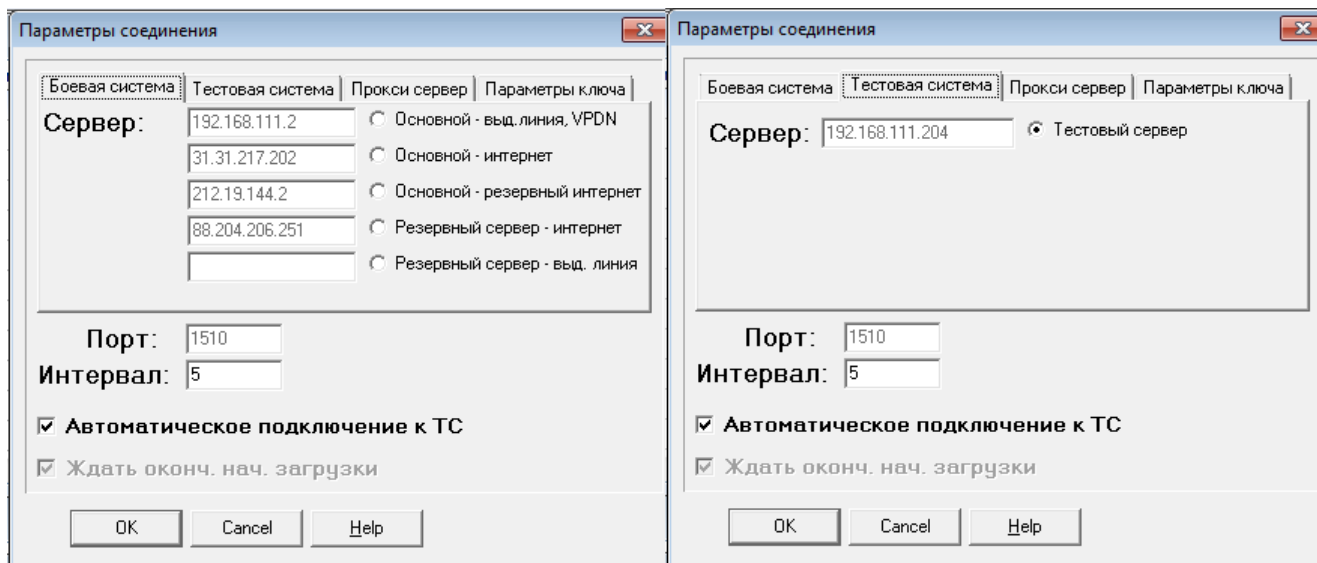
¹ Сохранение настроек пользователя осуществляется автоматически при выходе из торговой системы Биржи при включенной опции **"Сохранять настройки"** в меню **"Настройки"**. Настройки пользователя также можно сохранить, удерживая клавишу **"Shift"** при выходе из торговой системы Биржи.

Пользователь может выбрать тип соединения с сервером торговой системы Биржи в окне "**Параметры соединения**", которое можно открыть двумя способами:

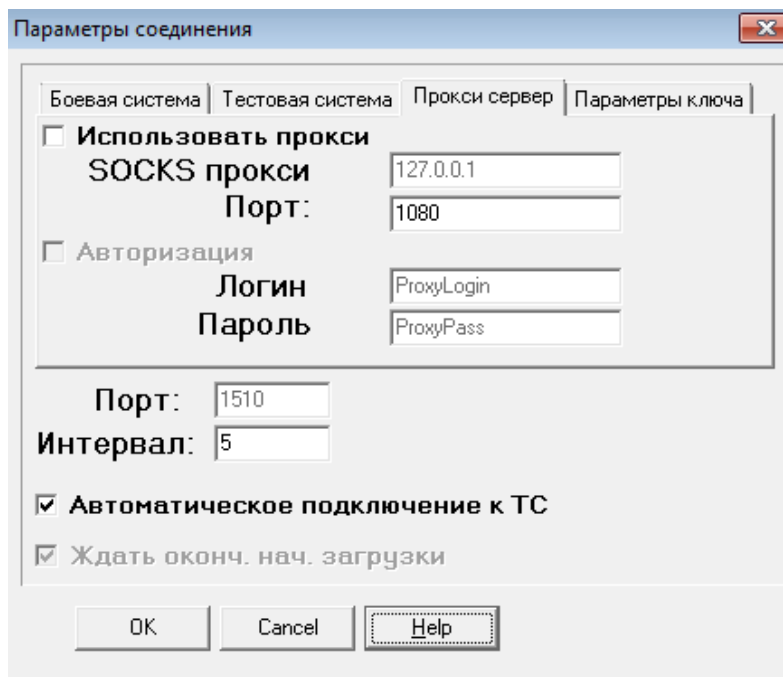
- 1) через окно "**Регистрация**" путем нажатия кнопки "**Settings**". При этом соединение с сервером торговой системы Биржи прерывается автоматически;
- 2) через меню "**Соединение**" главного меню.

При переходе в режим выбора типа соединения появляется окно "**Параметры соединения**".

Доступны два типа соединения ("Боевая система" и "Тестовая система"), которые находятся в разных вкладках окна "Параметры соединения". "Боевая система" предназначена для подключения к реальным биржевым торгам, "Тестовая система" – к тестовым торгам.



У пользователя также есть возможность подключения к терминалу через прокси-сервер. Для этого необходимо в параметрах соединения во вкладке "Прокси сервер" выбрать чек "**Использовать прокси**" и ввести адрес и порт сервера. Если при подключении к сети необходима авторизация на прокси-сервере, установите чек на "Авторизация" и заполните имя пользователя и пароль.



При выборе во вкладке "Параметры ключа" опции **"Использовать SSL"** будет применено **SSL-соединение** с сервером торговой системы Биржи. В противном случае будет применяться **TCP-соединение**.

Примечание при выборе SSL-соединения необходимо указать также носитель ключевой информации (токен (опция **"i-Key"**) или файл).

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

Глава 3. Интерфейс рабочего места пользователя

3.1. Функции главного меню программы

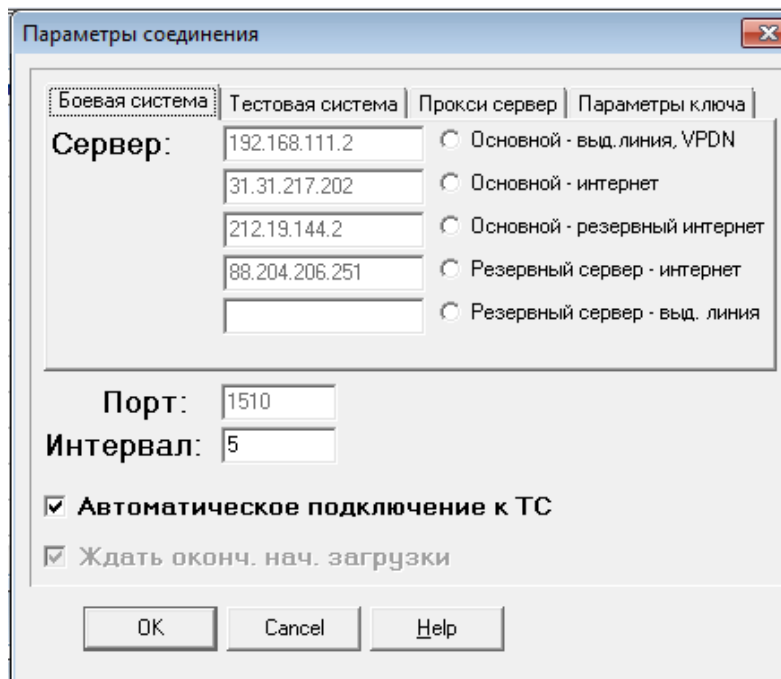
Содержание главного меню может зависеть от того, с какими объектами работает пользователь Торговой системы Биржи в текущий момент времени. После прохождения регистрации в главном меню дополнительно появляется меню активного окна и меню **"Действия"**.

Соединение Просмотр Инструмент Действия Отчеты Настройки Окно Помощь

3.1.1. Меню "Соединение"

Меню **"Соединение"** содержит пункты:

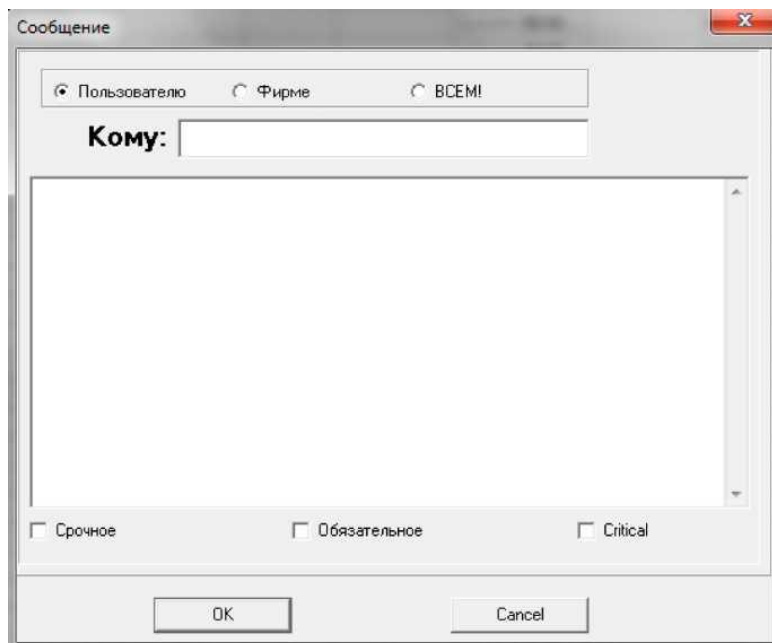
- **"Установить"** – с помощью этой функции пользователь устанавливает соединение с сервером;
- **"Параметры"** (**Alt+F8**) – открывает диалоговое окно **"Параметры соединения"**.



Редактируемые параметры означают следующее:

- Сервер** – доменное имя сервера или его IP адрес

- Основной – выд. линия, VPDN** – связь с сервером осуществляется через выделенный канал
- Основной – интернет** – связь с сервером осуществляется через Интернет–канал
- Основной – резервный интернет** – связь с сервером осуществляется через резервный Интернет–канал
- Резервный сервер – интернет** – связь с резервным сервером осуществляется через Интернет–канал
- Резервный сервер – выд. линия** – связь с резервным сервером осуществляется через выделенный канал
- Тестовый сервер** – связь с тестовым сервером
- Порт** – номер порта для соединения с сервером
- Интервал** – интервал обращения терминала к серверу с целью обновления информации (в секундах). Оптимальное значение – 5 секунд, поскольку при меньшем значении терминал перегружает трафик частыми запросами к серверу
- Автоматическое подключение к ТС** – при отсутствии связи по выделенной линии терминал автоматически пытается подключиться поочередно к остальным каналам
- **"Socket log" (Alt+F7)** – признак необходимости протоколирования сокета
- **"Сообщение" (Ctrl+H)** – отправить текстовое сообщение



- Пользователю** – сообщение может быть адресовано любому пользователю
- Фирме** – сообщение адресовано пользователям одной фирмы

Всем	–	оператор имеет право адресовать сообщение всем пользователям торговой системы Биржи
Срочное	–	опция, позволяющая пользователю получить сообщение в срочном порядке
Обязательное	–	опция, позволяющая пользователю получить сообщение вне зависимости от статуса соединения
Critical	–	опция для уведомления о некоторых событиях (нарушение обязательств маркет-мейкера, приостановка торгов, сообщения от маклера со статусом " Critical ", сообщение о запрете на заключение сделок по одному торговому счету). Подобный класс сообщений окрашивается в красный цвет в списке сообщений и в области информационной бегущей строки при непрочитанном сообщении.

Все принятые за день сообщения можно посмотреть в окне **"Сообщение"** (Ctrl+B).

- **"SSL"** – процедура генерации нового пароля и ключей пользователя и получения нового сертификата открытого ключа пользователя от Центра сертификации при **SSL – соединении**. Данная функция содержит опцию **"Генерация собственных ключей"**, которая позволяет пользователю собственноручно произвести генерацию ключей;
- **"Поменять свой пароль"** – функция, позволяющая пользователю (работающему без токена с носителем информации) в любой момент времени его работы с торговой системой Биржи заменить собственный пароль при **TCP – соединении**;
- **"Отправить файл на сервер"** – данная функция позволяет выбрать необходимый файл на локальных информационных ресурсах пользователя и передать его на сервер торговой системы;

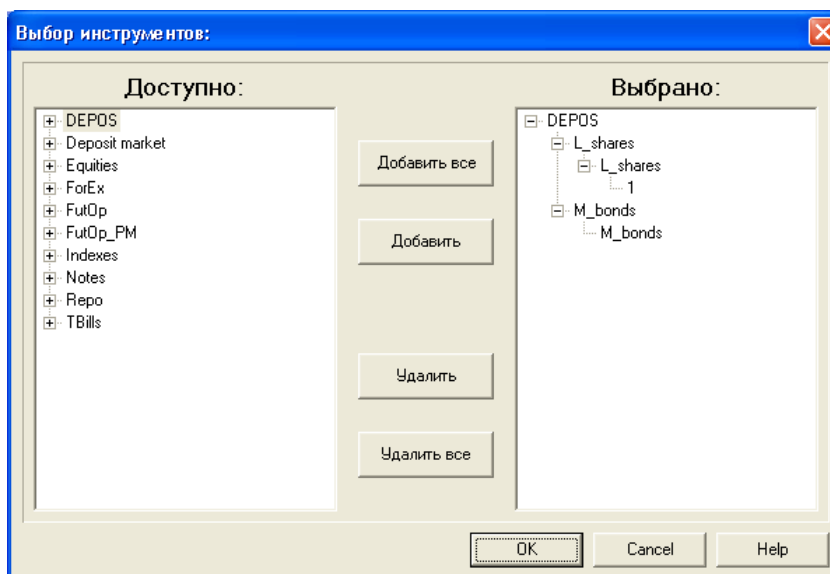
Внимание! Биржа принимает файлы только форматов Microsoft® Office и Adobe® Acrobat®.

- **"Выход"** (Alt+X) – завершение сеанса работы.

3.1.2. Меню "Просмотр"

Пункты меню **"Просмотр"** позволяют открывать окна с различными информационными таблицами, подробную информацию по работе с которыми смотрите в главе **"Структура торговой системы Биржи"**. Кроме того, в данном меню имеются пункты:

- **"Описание отчетов"** (Ctrl+E) – с информацией обо всех формах отчетности.
- **"Календарь"** – переход в окно **"Календарь"**;
- **"System log"** (F7) – переход в соответствующее окно **"System log"**. Более подробная информация приведена в пункте **"Системная информация"**;
- **"Выбор инструментов"** – F2, переход в соответствующее окно.



Окно содержит два списка финансовых инструментов иерархической структуры. В списке **"Доступно"** представлен полный перечень доступных инструментов, а в списке **"Выбрано"** – выбранные пользователем для сеанса работы.

Кнопка **"Добавить всё"** добавляет в список выбранных все доступные инструменты, **"Добавить"** – только отмеченные курсором в списке доступных.

Кнопки **"Удалить"** и **"Удалить всё"** удаляют один или все инструменты из списка выбранных.

- **"Обновить экран"** (F5) – функция, позволяющая пользователю самостоятельно в любой момент времени произвести обновление информации на своем рабочем месте вне зависимости от параметра **"Интервал"**, заданного в окне **"Параметры соединения"**;
- **"Обновить календарь"** – функция, позволяющая оператору в автоматическом режиме обновить календарь.

3.1.3. Меню "Действия"

Меню появляется в главном меню в случае, если пользователь имеет возможность совершать операции по какому-либо инструменту или действия по управлению объектами торговой системы Биржи. Функции меню меняются в зависимости доступных пользователю действий.

3.1.4. Меню "Отчеты"

Меню **"Отчеты"** позволяет пользователю работать с электронными документами и содержит пункты:

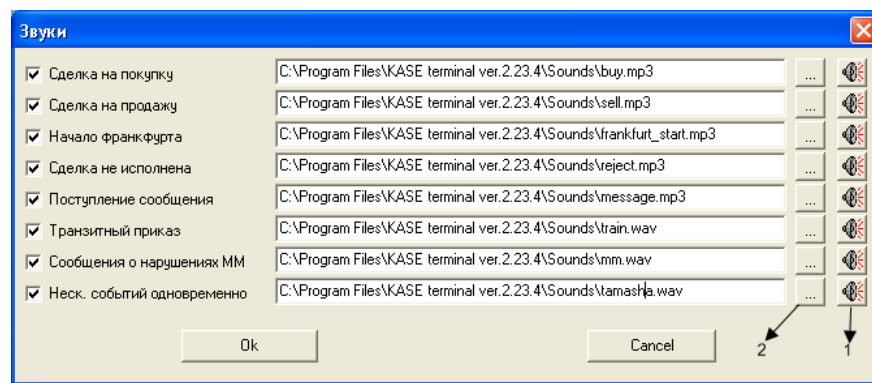
- **"Получить документы с сервера"** – в любой момент работы с торговой системой Биржи пользователь может получить информацию о наличии электронных документов;
- **"Просмотреть/напечатать документ"** – в любой момент работы с торговой системой Биржи пользователь может просмотреть и распечатать электронные документы.

Информацию о работе с электронными документами можно получить в главе **"Электронный документооборот"**.

3.1.5. Меню "Настройки"

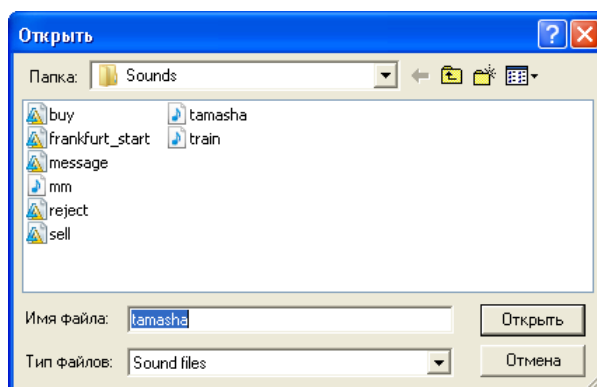
Меню **"Настройки"** может быть использовано для установки режимов отображения информации и параметров терминала в соответствии с потребностями пользователя. Данное меню включает следующие пункты:

- **"Используемый язык"** – возможность установки языка интерфейса клиента – **"Русский"** (**Ctrl+F12**) или **"Английский"** (**Ctrl+F11**);
- **"Показывать сообщения"** – опция, при установке которой (по умолчанию), принятое сообщение показывается на экране терминала пользователя. Принятые сообщения можно просмотреть в окне **"Сообщения"**. Системные и глобальные сообщения в любом случае показываются на экране терминала;
- **"Автоподбор лучших цен"** – опция, при установке которой (по умолчанию) в случае ввода заявки методом открытых торгов автоматически будут предложены параметры лучшей встречной котировки;
- **"Подтверждение заявок"** – опция, при установке которой торговая система Биржи во избежание ошибок и для дополнительной проверки информации запрашивает дополнительное подтверждение на ввод заявки;
- **"Сообщение о тр. приказах"** – опция, при установке которой в случае подачи транзитных приказов автоматически будут приходить сообщения;
- **"Напоминание о депозитных ставках"** – опция, при установке которой пользователь в автоматическом режиме получает напоминание о депозитных ставках;
- **"Отключить градацию цвета"** – опция, при выборе которой отключается градация цвета;
- **"Звуки"** – переход в соответствующее окно. В открытом окне **"Звуки"** указываются перечень событий, для которых предусмотрены звуковые сигналы, и файлы звуковых сигналов, сопровождающих эти события.



Для каждого события, которое может быть сопровождено звуковым сигналом, предусмотрены служебные кнопки:

- 1 – кнопка предназначена для прослушивания выбранного файла звукового сигнала;
- 2 – кнопка "Обзор" предназначена для выбора желаемого файла звукового сигнала. При ее нажатии появляется окно "Открыть", с помощью которого можно выбрать звуковой файл из числа доступных (типа .mp3, .wav или другой).



Для удобства пользователей в торговой системе Биржи предусмотрено сопровождение **звуковыми сигналами** (уведомления) следующих событий:

- заключения сделки участником торгов (с возможностью настройки звукового сигнала в зависимости от направления сделки – продажи или покупки финансового инструмента);
- перевода торгов каким-либо финансовым инструментом в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов;
- неисполнения сделки (неосуществления расчетов по сделке) ввиду отсутствия (недостатка) у ее сторон денег или финансового инструмента или отказа участника системы подтверждения от подтверждения данной сделки;
- поступления нового транзитного приказа участнику торгов от его Интернет-клиента;
- поступления нового сообщения через торговую систему Биржи.

Предупреждение В торговой системе Биржи предусмотрен отдельный звуковой сигнал для уведомления о возникновении нескольких из вышеуказанных событий, одновременно зарегистрированных при обновлении информации на терминале.

По умолчанию звуковые сигналы в торговой системе Биржи включены.

- **"Ошибки МО на экран"** – опция, при выборе которой все сообщения об ошибках отображаются на экране в отдельном диалоговом окне;

Внимание! Рекомендуется включать данную опцию в обязательном порядке. В случае если опция не активна, пользователь не будет знать о выполнении ошибочного действия, так как сообщения об ошибках не будут выводиться на экран.

- **"Сохранять заявки в файл"** – опция, позволяющая сохранять поданные заявки;
- **"Настройки пользователя"** – опция, позволяющая сохранять текущие настройки пользователя в файл. Данная функция позволяет восстановить настройки пользователя в случае:
 - смены терминала
 - смены участником торгов его рабочего места
 - переустановки операционной системы

Такой файл с настройками может быть сохранен локально на персональном компьютере пользователя и на внешних носителях информации.

Внимание! Файл с настройками определенного пользователя можно будет использовать только для загрузки настроек именно этого пользователя.

- **"Сохранить в..."** – опция, позволяющая пользователю сохранить собственные настройки в случае смены текущей версии терминала либо операционной системы. Для этого следует предварительно загрузить терминал, после чего выбрать место для сохранения файла. Если планируется перенести текущие настройки на другой персональный компьютер, следует сохранить файл на съемном носителе информации с целью его последующего переноса на новое рабочее место;
- **"Загрузить из файла..."** – опция, позволяющая загрузить терминал, указывая путь к файлу с настройками.
- **"Сохранять настройки"** – опция, позволяющая при выходе из программы автоматически сохранять настройки пользователя (расположение окон при выходе, параметры соединения и т. п.).

3.1.6. Меню "Окно"

Функции меню **"Окно"** предназначены для работы с окнами в торговой системе Биржи.

- **"Экспорт в файл" (Alt+F10)** – сохранение в отдельном файле в формате .xls или .htm (в дополнение к формату .txt) данных активного окна-таблицы. В появившемся диалоговом окне можно выбрать нужный тип (формат) файла и присвоить ему имя;
- **"Заблокировать доступ" (F11)** – опция, позволяющая при необходимости блокировать доступ к рабочему месту пользователя без разрыва соединения с сервером торговой системы Биржи;

Функции **"Упорядочить каскадно"**, **"Упорядочить свернутые"**, **"Свернуть все"**, **"Закрывать"** и **"Закрывать все"** предоставляют стандартные возможности работы с окнами в среде Windows.

3.1.7. Меню "Справка"

Меню **"Справка"** содержит функцию **"Об этой программе" (Alt+F1)**, которая дает информацию о версии терминала и контактные реквизиты.

3.2. Строка управления

Строка управления содержит набор кнопок, позволяющих быстро инициализировать наиболее часто используемые операции.

Назначение кнопок строки управления:














- выбор рабочего набора инструментов



- открытие окна **"Избранные финансовые инструменты"**

Кнопка **"Инструменты"** – открытие окна **"Финансовые инструменты"**

Кнопка **"Заявки"** – открытие окна **"Заявки"**

Кнопка "Сделки"	– открытие окна "Сделки"
	– ввод заявки на покупку методом открытых торгов
	– ввод заявки на продажу методом открытых торгов
	– одновременный ввод заявок на покупку и продажу методом открытых торгов;
Кнопка "Direct"	– ввод заявки на покупку/продажу методом заключения прямых сделок
Кнопка "Repo"	– ввод репо-заявки методом заключения прямых сделок
	– просмотр торговых счетов
	– просмотр позиционных счетов
	– получение документов с сервера
	– просмотр и печать полученных документов с сервера
	– отправка сообщений другим пользователям
	– блокирование доступа к рабочему месту участника торгов
	– оперативная отправка сообщения администратору торговой системы. При нажатии кнопки обратной связи на панели инструментов осуществляется запуск почтового клиента с заданными по умолчанию параметрами получателя сообщения и темы письма
	– выход из торговой системы Биржи

3.3. Рабочий стол пользователя

Рабочий стол пользователя представляет собой набор информационных таблиц. Некоторые из таких таблиц открываются сразу при входе в торговую систему Биржи, остальные открываются во время работы с торговой системой Биржи.

Внешне элементы таблиц соответствуют внешнему виду стандартных окон операционной системы Microsoft Windows, что сделано для быстроты их восприятия пользователями торговой системы Биржи.

Все информационные таблицы для удобства пользования имеют собственные настройки, приведенные ниже.

Перемещение столбцов

Столбец в окне-таблице можно переместить при помощи "мыши". Для этого необходимо выбрать нужный столбец нажатием левой кнопки "мыши" и, не отпуская ее, переместить этот столбец в желаемое место.

№ /	Группа	Наименование	Код	Полное наименование	Со...	Забл...	Стр
385	Repo	R_ATFBb6_014	R_ATFBb...	Repo сроком на семь дней по INSTR...	T		
386	Repo_ATFBb6	R_ATFBb6_014	R_ATFBb...	Repo сроком на четырнадцать дне...	T		
387	Repo_ATFBb6	R_ATFBb6_028	R_ATFBb...	Repo сроком на двадцать восемь д...	T		
388	Repo_ATFBb6	R_ATFBb6_001	R_ATFBb...	Repo сроком на один день по INSTR...	T		
389	Repo_ATFBb6	R_ATFBb6_003	R_ATFBb...	Repo сроком на три дня по INSTR...	T		
390	Repo_ATFBb6	R_ATFBb6_007	R_ATFBb...	Repo сроком на семь дней по INSTR...	T		

Сортировка строк

Строки в окне-таблице можно отсортировать по возрастанию или убыванию значений элементов того или иного столбца. Для этого необходимо щелкнуть левой клавишей "мыши" по заголовку нужного столбца.

Одинарный щелчок левой клавиши "мыши" по заголовку столбца изменяет сортировку строк по значениям элементов данного столбца с сортировки "по возрастанию" (↕) на сортировку "по убыванию" (↕) или обратно.

№	Инструмент	Номер	Заявка	В/С	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована
2	EABRK280414	17	3 57...	B	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:16 24.04...
1	EABRK280414	17	3 57...	S	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:16 24.04...
4	EABRK280414	51	3 57...	B	56.6951	10 000 000	12902	1028100000	11:41:14 25.04...
3	EABRK280414	51	3 57...	S	56.6951	10 000 000	12902	1028100000	11:41:14 25.04...
5	EABRK280414	127	3 57...	S	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:10 27.04...
6	EABRK280414	127	3 57...	B	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:10 27.04...

№	Инструмент	Номер	Заявка	В/С	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована
6	EABRK280414	127	3 57...	B	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:10 27.04...
5	EABRK280414	127	3 57...	S	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:10 27.04...
4	EABRK280414	51	3 57...	B	56.6951	10 000 000	12902	1028100000	11:41:14 25.04...
3	EABRK280414	51	3 57...	S	56.6951	10 000 000	12902	1028100000	11:41:14 25.04...
1	EABRK280414	17	3 57...	S	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:16 24.04...
2	EABRK280414	17	3 57...	B	0.0000	10 000 000	12902	1028100000	11:41:16 24.04...

Внимание! В окнах "Котировки" и "Прямые котировки" функция сортировки недоступна.
Для возврата к первоначальному расположению строк окна-таблицы необходимо выполнить сортировку строк "по возрастанию" по значениям элементов столбца.

Поиск данных

Для вызова функции поиска необходимо нажать клавишу **F3** в окне, в котором требуется найти объект, после чего внести в окно поиска искомое значение с учетом регистра:

Заявки: 1104

№ /	Инструмент	Номер	B/S	Цена	Количество (нач.)	Объем (нач.)	Купон	Доходность	Количество (остаток)	Объем (остаток)	Сост.
3	GB_ENRC	4 878 872	S	752.21	7 500	5 641 575.00			7 480	5 626 530.80	Удовлетворена частично
4	GB_ENRC	4 878 873	B	703.00	7 500	5 272 500.00			7 490	5 265 470.00	Удовлетворена частично
5	GB_KZMS	4 878 866	S	1 901.39	3 000	5 704 170.00			2 930	5 571 072.70	Удовлетворена частично
6	GB_KZMS	4 878 867	B	1 777.00	3 000	5 331 000.00			3 000	5 331 000.00	Лимитированная*
7	HSBK	4 878 836	B	29.00	2	58.00			2	58.00	Лимитированная*
8	HSBK	4 878 838	B	30.00	6	180.00			3	90.00	Удовлетворена частично
9	HSBK	4 878 840	S	31.00	6	186.00			6	186.00	Лимитированная*
11	KZTK	4 878 885	S	13 518.96	20	270 379.20			20	270 379.20	Лимитированная*
12	KZTK	4 878 886	B	12 999.00	20	259 980.00			20	259 980.00	Лимитированная*

4 878 | Следующее | Предыдущее | Учет регистра

В большинстве случаев поиск по умолчанию настроен на столбец, являющийся в таблице основным. При поиске значений, находящихся в других столбцах, необходимо произвести сортировку по требуемому столбцу, для этого следует навести курсор на такой столбец и кликнуть по нему левой клавишей мыши. После выполнения данных действий в окно поиска следует ввести искомое значение.

В появившемся поле поиска данных можно использовать кнопки **"Следующее"** и **"Предыдущее"** для дальнейшего поиска аналогичного значения. В случае установленной опции **"Учет регистра"** поиск проводится с полным соответствием прописных и строчных букв.

Заявки: 1104

№	Инструмент	Номер	B/S	Цена	Количество (нач.)	Объем (нач.)	Купон	Доходность	Количество (остаток)	Объем (остаток)	Сост.
10	KCEL	4 879 165	B	1 728.48	10 000	17 284 800.00		1.90	10 000	17 284 800.00	Активная
19	EXBN	4 877 907	S	540.00	10 000	5 400 000.00			10 000	5 400 000.00	Лимитированная*
20	EXBN	4 877 908	B	490.91	10 000	4 909 100.00			10 000	4 909 100.00	Лимитированная*
21	EABRK280414	4 879 057	S	113.9400	10 000 000	11 394 000.00			10 000 000	11 394 000.00	Лимитированная*
22	EABRK280414	4 879 058	B	105.5000	10 000 000	10 550 000.00			10 000 000	10 550 000.00	Лимитированная*

10 | Следующее | Предыдущее

Внимание! При поиске числовых значений с четырьмя разрядами и более необходимо использовать пробел в качестве разделителя разрядов.

Навигационная панель

Навигационная панель расположена в верхней части окон **"Торговые счета"**, **"Позиционные счета"**, **"Заявки"** и **"Сделки"**.

Заявки: 1082

№ /	Инструмент	Номер	B/S	Цена	Количество (нач.)	Объем (нач.)	Купон	Доходность	Количество (остаток)	Объем (остаток)	Сост.
1076	USDKZT_TOD	4 880 260	B	149.24	300 000	44 772 000.00			300 000	44 772 000.00	Лимитированная
1077	USDKZT_TOD	4 880 261	B	149.25	100 000	14 925 000.00			100 000	14 925 000.00	Лимитированная
1078	USDKZT_TOD	4 880 262	B	149.24	400 000	59 696 000.00			400 000	59 696 000.00	Лимитированная
1079	USDKZT_TOD	4 880 263	B	149.19	500 000	74 595 000.00			500 000	74 595 000.00	Лимитированная
1080	USDKZT_TOD	4 880 264	B	149.19	300 000	44 757 000.00			300 000	44 757 000.00	Лимитированная
1081	USDKZT_TOD	4 880 265	B	149.18	200 000	29 836 000.00			200 000	29 836 000.00	Лимитированная
1082	USDKZT_TOD	4 880 266	B	149.16	100 000	14 916 000.00			100 000	14 916 000.00	Лимитированная

2 / 2

Она дает возможность перемещаться по страницам следующими способами:

- с помощью кнопок навигации "вправо", "влево", "в начало", "в конец";

- посредством ввода номера существующей страницы непосредственно в окне навигационной панели. После ввода соответствующего номера страницы необходимо нажать "Enter".

Примечание Кнопки навигации отображаются в верхней части окна при количестве записей в таблице более 1 000 строк.

3.4. Строка состояния

Строка состояния расположена в нижней части экрана рабочего места участника торгов.

Она предназначена для отображения служебной информации и содержит следующие поля:

Server time	–	время сервера, терминал работает в соответствии с ним вне зависимости от времени, установленного на персональном компьютере пользователя
Server date	–	текущая дата на сервере
Connection time	–	продолжительность сеанса работы
Traffic	–	объем передаваемой между терминалом и сервером информации
Connected: TCP session	–	сообщение о нормальном состоянии соединения. В случае потери связи с сервером появится " DISCONNECTED " (выделенное красным цветом фона);
Начальная загрузка	–	информация, свидетельствующая об окончании процесса начальной загрузки

Меняющееся значение поля "**Traffic**" означает, что терминал имеет нормальное соединение с сервером. В случае отсутствия соединения рекомендуется произвести перезапуск программы или обратиться за помощью к специалистам Биржи.

3.5. Главное окно рабочего места пользователя

Главное окно рабочего места пользователя содержит:

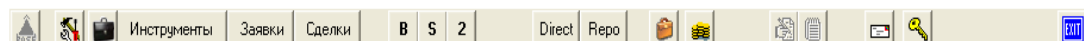
- заголовок идентификатора пользователя и наименование его полномочий;

 Рабочее место участника торгов - 00101 on pluton2-1538 (ТЕСТОВАЯ СИСТЕМА)

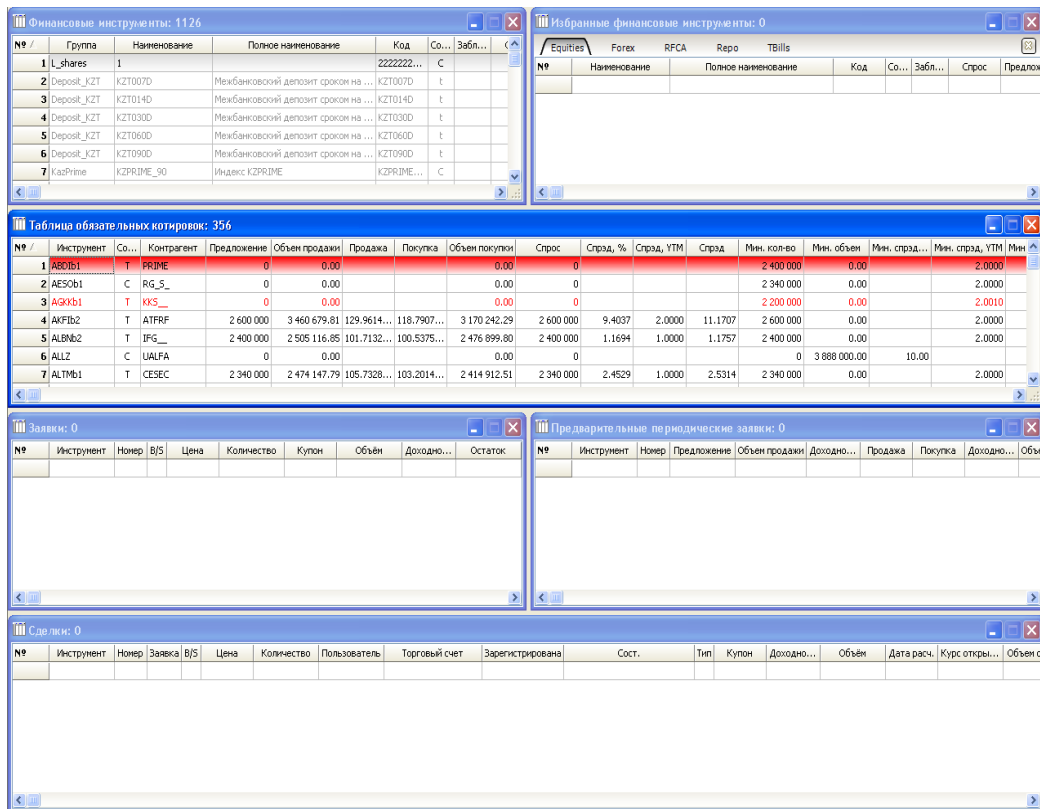
- главное меню рабочего места пользователя, предназначенное для инициализации любых операций из тех, что доступны пользователю с учетом предоставленных ему в торговой системе Биржи прав;

Соединение Просмотр Таблица обязательных котировок Действия Отчеты Настройки Окно Помощь

- строку управления;



- рабочий стол с информационными окнами (таблицами), которые открываются пользователем во время работы с торговой системой Биржи;



- строку состояния.

Server time: 12:23:58 | Connection time: 01:08:59 | Traffic: (0) 0 | Connected: TCP session. | Начальная загрузка закончена

Глава 4. Структура торговой системы Биржи

4.1. Рынки

Каждый пользователь имеет определенный доступ к определенным финансовым инструментам. Иерархически структура объектов торговли в торговой системе Биржи определена следующим образом, начиная с самой верхней: **"Рынки"** – **"Секторы рынка"** – **"Группа инструментов"** – **"Финансовый инструмент"** – **"Валюты"**.

Рынок является верхним уровнем иерархического разделения объектов торговли. Открыть окно **"Рынки"** можно следующим образом:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр"** – **"Структура рынка"** – **"Рынки"**;
- нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+M**.

№ /	Наименование	Полное наименование	Код
2	Deposit market	Рынок межбанковских депозитов	
3	Equities	Рынок акций и облигаций	E
4	ForEx	Рынок иностранных валют	F
5	FutOp	Рынок срочных контрактов	D
6	FutOp_PM	Рынок срочных контрактов (PM)	P
7	Indexes	Индексы	I
8	Notes	Рынок векселей	N
9	Repo	Рынок автоматического репо	R
10	TBills	Государственные ценные бумаги	T

Столбцы окна:

Наименование – краткое общепринятое наименование рынка

Полное наименование – полное наименование рынка

общепринятые сокращения состояний рынков:

"E" – рынок акций и облигаций

"F" – рынок иностранной валюты

"D" – рынок срочных контрактов

"N" – рынок векселей

Код – **"P"** – рынок срочных контрактов на драгоценные металлы

"R" – рынок "автоматического" репо,

"T" – государственные ценные бумаги

"I" – индексы

Нажатие правой клавиши "мыши" по выбранному рынку открывает доступ к функциям:

- **"Секторы"** (**Ctrl+Enter** (двойной щелчок мыши), **Alt+1**) – переход в окно **"Секторы рынка"**;
- **"Подключить"** (**Ctrl+1**), **"Отключить"** (**Ctrl+2**) – активирование либо деактивирование инструментов, входящих в данный рынок;
- **"Очистить рынок"** (**Ctrl+3**) – используется операторами для очистки рынка;
- **"Дать права..."** (**Ctrl+5**) – используется операторами для предоставления прав пользователям;
- **"Добавить"** (**Ins**) – используется операторами для добавления рынка;
- **"Удалить"** (**Del**) – используется операторами для удаления рынка;
- **"Свойства"** (**Alt+Enter**) – при выборе на экране появляется окно **"Параметры рынка"**, которое дает пользователю краткую информацию о рынке: код и наименование рынка. Флажок **"Фондовый"** означает, что инструменты данного рынка имеют атрибуты для торговли ценными бумагами.

4.2. Сектор рынка

В окне **"Секторы рынка"** содержится информация о секторах рынка. Открыть окно **"Сектор рынка"** можно следующим образом:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр"** – **"Структура рынка"** – **"Секторы"**;

- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+S**.

№ /	Наименование	Полное наименование	Рынок	Заблок.
1	l_shares	Листинговые ценные бумаги	DEPOS	
2	M_bonds	Муниципальные облигации	DEPOS	
3	Deposit_KZT	Сектор межб. депозитов в KZT	Deposit market	
4	Deposit_USD	Сектор межб. депозитов в USD	Deposit market	
5	Debts_List	Листинговые долговые ЦБ	Equities	
6	Debts_List_ST	Листинговые долговые ЦБ (СТ)	Equities	
7	Direct Repo	Прямое репо	Equities	
8	Eqs_List	Листинговые акции (с ФА)	Equities	
9	Eqs_List_No_Fra	Листинговые акции (без ФА)	Equities	
10	Eqs_List_ST	Листинговые акции (СТ)	Equities	
11	Eqs_Nonlist	Нелистинговые акции	Equities	

Нажатие правой клавиши "мыши" по выбранному сектору открывает доступ к функциям:

- **"Группы"** (**Ctrl+Enter** (двойной щелчок мыши), **Alt+1**) – переход в окно **"Группы инструментов"**;
- **"Репо-обязательства"** (**Alt+2**) – переход в соответствующее окно;
- **"Подключить"** (**Ctrl+1**), **"Отключить"** (**Ctrl+2**) – активирование либо деактивирование инструментов, входящих в данный сектор;
- **"Приостановить сессии"** (**Ctrl+3**), **"Продолжить сессии"** (**Ctrl+4**) – оператор может приостановить торговые сессии по инструментам сектора, а также продолжить торги (после приостановления);
- **"Дать права..."** (**Ctrl+5**) – используется операторами для предоставления прав пользователям;
- **"Очистить сектор"** (**Ctrl+6**) – оператор может переместить заявки и сделки по всем инструментам сектора в архивную базу данных;
- **"Снять заявки"** (**Ctrl+7**) – оператор может снять все заявки по инструментам сектора;
- **"Закрытое размещение"** (**Ctrl+8**) – оператор может открыть торги по размещению или выкупу инструментов сектора;
- **"Открыть торги (вторичное разм.)"** (**Ctrl+9**) – оператор может ежедневно открывать торги по инструментам сектора;
- **"Закреть торги"** (**Ctrl+0**) – оператор может закрыть любые торги по инструментам сектора;
- **"Открыть торги (первичное разм.)"** – оператор может открыть торги по инструментам сектора при первичном размещении инструмента;
- **"Удалить"** (**Del**) – используется операторами для удаления сектора;
- **"Свойства"** (**Alt+Enter**) – при выборе на экране появляется окно **"Параметры сектора рынка:..."**.

Списки параметров сектора рынка и параметров финансового инструмента в основном совпадают, что сделано с целью автоматического присвоения значений параметров сектора рынка значениям параметров инструмента при вводе нового инструмента в торговую систему Биржи. Ниже приводится описание параметров, которые устанавливаются только в секторе рынка.

В закладке **"Основные"** имеются следующие параметры для секторов рынка:

- | | |
|----------------------------|---|
| Наименование | – код инструмента |
| Полное наименование | – официальное наименование инструмента на русском и английском языках |
| Заблокирован | – при включении блокируется выбранный сектор рынка |

Сектор векселей – при включении определяется принадлежность к сектору векселей

Подробная информация о работе рынков "автоматического" репо и векселей приведена в пунктах "[Автоматическое репо](#)" и "[Заклучение сделок](#)".

Закладка "[Допол.](#)" содержит следующие специфичные для сектора рынка параметры:

Метод произведения расчетов	–	опция, позволяющая оператору установить метод, с помощью которого будут произведены расчеты
Тип ценных бумаг	–	опция, позволяющая оператору установить тип ценных бумаг
Сумма в установленной валюте	–	опция, которая устанавливает необходимость определения расчетной суммы сделок, совершенных с инструментами сектора, в установленной валюте
Дата открытия, Дата закрытия	–	опция, определяющая, будут ли инструменты данного сектора содержать в качестве параметров даты начала и конца обращения
Спец. торги	–	опция, определяющая принадлежность выбранного сектора к специализированным торгам
Своп	–	опция, определяющая принадлежность данного сектора к своп-операциям
Приостановка торгов и выдача предупреждения	–	в случае снижения значения цены по сравнению с последним значением цены предыдущего дня на величину, установленную в параметрах "Группы инструментов", активируются приостановка торгов и выдача предупреждений
Процент отклонения для выдачи предупреждения	–	в случае отклонения значения цены от последнего значения цены предыдущего дня на данную величину, операторам выдается предупреждение об отклонении
Процент отклонения для открытия франкфурта	–	процент отклонения для открытия франкфуртского аукциона, выставляемый оператором
Отправлять файлы в ручную	–	опция, позволяющая оператору отправлять файлы самостоятельно
Режим отложенных расчетов	–	опция, позволяющая произвести выбор срока расчета
Тайм-аут для ММ (мин.)	–	промежуток времени в течение торгового дня, предоставляемый маркет-мейкеру для выставления новых значений обязательных котировок, в течение которого маркет-мейкеру разрешается не выполнять свои обязательства

Закладка "[Цена](#)" содержит опцию, позволяющую выбрать метод определения предыдущей средневзвешенной цена для утренней сессии (как средневзвешенная цена предыдущей утренней сессии или средневзвешенная цена последней сессии).

Закладка "**Заявки**" содержит следующие специфичные для сектора рынка опции:

Лимитированные	– заявка на покупку или продажу с указанием цены инструмента, ниже или выше которой соответственно участник, подавший заявку, согласен заключить сделку
Рыночные	– заявка без указания цены инструмента, обуславливающая желание участника, подавшего ее, заключить сделку по наилучшей встречной цене на момент подачи заявки
Репо	– операция с финансовым инструментом, включающая в себя одновременное заключение двух противоположных по направлению сделок (открытия и закрытия) на одинаковое количество финансовых инструментов с различными сроками исполнения
Двойная заявка	– заявка, подаваемая в торговую систему Биржи одновременно в противоположных направлениях (на покупку и продажу)
Прямые	– заявка, поданная участником торгов с целью заключения прямой сделки. Прямая заявка адресуется участнику – предполагаемому контрагенту по сделке
Прямые сделки подтверждает маклер	– прямая сделка, которую в обязательном порядке должен подтвердить маклер
Прямые котировки	– котировка, поданная в торговую систему Биржи методом прямых (индикативных) котировок
Скрытое количество разрешено	– в лимитированной заявке разрешено указать количество и скрытое количество; при этом в котировках отображается только количество; при его удовлетворении система формирует еще одну аналогичную заявку с тем же количеством. Данный процесс продолжается, пока не будет удовлетворено все скрытое количество заявки
Приобретенное количество недоступно до расчетов по сделке	– трейдер, купивший инструмент, не может его продать до осуществления расчетов по сделке на покупку
Заявки сохраняются до указанной в них даты	– позволяет устанавливать дату истечения срока действия заявки

Для франкф. или открытого аукциона	–	если включена опция "Режим ожидания" , то при попытке заключения сделки методом открытых торгов торги по инструменту переводятся в режим ожидания, во время которого торговля осуществляется методом франкфуртских торгов в течение определенного времени, установленного параметрами "мин. ожидание" , "доп. ожидание" , "макс. ожидание" , "принудительное завершение" согласно утвержденному Регламенту торгов
Контроль прямых сделок	–	величина, которой ограничивается срок при подаче заявки "прямого" репо методом заключения прямых сделок, а также пролонгации операции "прямого" репо
Ожидание заявки	–	время (в минутах), по истечении которого объявленная заявка будет удовлетворена без использования режима ожидания
Случайное закрытие франкфурта	–	опция, позволяющая активировать механизм случайного закрытия франкфуртского аукциона
Интервал случайного закрытия	–	интервал времени (в минутах) в пределах которого сработает случайное закрытие франкфуртского аукциона

Описание остальных параметров приведено в пункте **"Финансовые инструменты"**.

4.3. Группы инструментов

Открыть окно **"Группы инструментов"** можно следующим образом:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр" – "Структура рынка" – "Группы"**;
- нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+G**.

№ /	Наименование	Полное наименование	Сектор	Код
6	Rated	С рейтинговой оценкой	Debts_List	0
7	Unrated_I	Без рейтинговой оценки (I)	Debts_List	0
8	Unrated_II	Без рейтинговой оценки (II)	Debts_List	0
9	Unrated_II_KR	Без рейтинговой оценки (II), KR	Debts_List	0
10	Unrated_I_KR	Без рейтинговой оценки (I), KR	Debts_List	0
11	Rated_KR_ST	Листинговые облигации A KR (CT)	Debts_List_ST	0
12	Rated_ST	Листинговые облигации A (CT)	Debts_List_ST	0
13	Direct Repo	Прямое Repo	Direct Repo	0
14	First	Первая категория	Eqs_List	0
15	First_E	Первая категория (эксперимент)	Eqs_List	0
16	Second	Вторая категория	Eqs_List	0
17	Second_E	Вторая категория (эксперимент)	Eqs_List	0

Группа инструментов служит для выделения в отдельный логический список финансовых инструментов, отличающихся однородными свойствами в пределах сектора рынка. Каких-либо специальных параметров по группе инструментов в торговой системе Биржи не предусмотрено.

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной группе инструментов открывает доступ к следующим функциям:

- **"Инструменты"** (**Ctrl+Enter** (двойной щелчок "мыши"), **Alt+1**) – переход в окно **"Финансовые инструменты"**, описание действий приведено в пункте **"Финансовые инструменты"**;
- **"Подключить"** (**Ctrl+1**), **"Отключить"** (**Ctrl+2**) – активирование либо деактивирование инструментов, входящих в данную группу;
- **"Удалить"** (**Del**) – используется операторами для удаления группы;
- **"Свойства"** (**Alt+Enter**) – при выборе на экране появляется окно **"Параметры группы инструментов"**.

Списки параметров группы инструментов и параметров финансового инструмента в основном совпадают, что сделано с целью автоматического присвоения значений параметров сектора рынка значениям параметров инструмента при вводе нового инструмента в торговую систему Биржи. В связи с этим ниже приводится описание параметров, которые устанавливаются только в группе инструментов.

В закладке **"Основные"** имеются следующие параметры для группы инструментов:

Рынок	– наименование рынка, к которому принадлежит группа инструментов
Сектор	– наименование сектора рынка, к которому принадлежит группа инструментов
S.W.I.F.T. code	– параметр, который выставляется оператором и предназначается для формирования данных, отправляемых в АО "Центральный Депозитарий ценных бумаг" (далее – Центральный депозитарий)
Наименование	– код группы инструментов
Полное наименование на русском языке	– официальное наименование группы инструментов на русском и английском языках
Полное наименование на английском языке	

Закладка **"Допол."** содержит следующие специфичные для группы инструментов параметры:

Индексация не может быть < 1	– при включении данной опции торговая система Биржи при коэффициенте девальвации/ревальвации равном < 1 рассчитывает объем сделки по индексированным облигациям, входящим в данную группу с учетом коэффициента равного 1
Проверка объекта авторепо для покупателя репо	– при включении в автоматическом режиме производится проверка объекта "автоматического" репо для покупателя
Группа для расчета рыночной цены	– числовой показатель, определяющий привязанность данной группы инструментов к такому же числовому показателю в окне "Параметры групп"
Приостановка торгов	– при включении происходит приостановка торгов по инструментам данной группы
Лимит для авт. приост. торгов по акциям 1 кат. (в %)	– если цена инструмента снизилась на величину, установленную в данном поле, относительно последней цены сделки предыдущего результативного торгового дня, торги по инструментам данной группы приостанавливаются

T+... – определяет дату расчетов сделок по инструменту

4.4. Финансовые инструменты

Окно **"Финансовые инструменты"** содержит информацию об объектах торговли. Открыть данное окно можно следующим образом:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр"** – **"Структура рынка"** – **"Инструменты"**;
- нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+I**.

№ /	Группа	Наименование	Код	Полное наименование	Сост.	Забл.	Спрос	Предложение	П.Спрос	П.Пред	Пред. ср. взв.	Посл. цена пр. дня
183	Unrated_J	EX8N61	KZRC1Y0...	Купонные облигации без обеспече...	T		75.9881 [21.03%]	80.3831 [18.72%]			76.2887 [20.87%]	76.2887
184	Unrated_J	EX8N62	KZRC2Y0...	Купонные облигации без обеспече...	T		83.8514 [22.29%]	86.9503 [19.79%]			79.3285 [26.18%]	79.2440
185	Unrated_J	EX8N63	KZRC3Y0...	Купонные облигации без обеспече...	T		95.9769 [10.45%]	104.1831 [8.29%]			81.3955 [14.94%]	81.3955
186	Unrated_J	HSBKb10	KZRC7Y1...	Купонные субординированные обл...	T		90.7687 [12.56%]	98.7260 [10.35%]			95.3081 [11.27%]	96.6552
187	Unrated_J	HSBKb11	KZRC3Y1...	Купонные субординированные обл...	T		90.2532 [10.16%]	99.0614 [8.05%]			93.2194 [9.42%]	93.2194
188	Unrated_J	HSBKb12	KZRC1Y1...	Купонные субординированные обл...	T		93.3782 [10.60%]	103.8061 [8.51%]			94.6008 [10.34%]	94.6008
189	Unrated_J	HSBKb13	KZRC2Y1...	Купонные субординированные обл...	T		113.8620 [11.20%]	126.9295 [9.04%]			115.0000 [11.0...]	115.0000

На рисунке показано, что столбцы окна были настроены специальным образом, чтобы наблюдать в окне наиболее важные параметры торгов по инструменту. Настройка параметров окон описана в пункте **"Рабочий стол пользователя"**.

Столбцы окна **"Финансовые инструменты"**:

- Группа** – код группы, к которой принадлежит инструмент
- Наименование** – код инструмента в соответствии с принятой на Бирже системой кодировки
- Полное наименование** – полное наименование инструмента
- Код** – код для связи с внешними системами (национальный идентификационный номер (НИН), если это ценная бумага)
состояние торгов по инструменту:
 - "A"**, **"U"** – размещение или выкуп (метод специализированных торгов)
 - "C"** – торги закрыты
 - "F"** – торги проводятся методом франкфуртского аукциона
 - "P"** – открыт предварительный прием заявок (метод непрерывного встречного аукциона)
 - "T"** – торги открыты (метод непрерывного встречного аукциона, метод заключения прямых сделок)
 - "t"** – торги приостановлены
 - "X"** – торги открыты (метод фиксинга)
 - "x"** – открыт предварительный прием заявок (метод фиксинга)
- Сост.** –
- Заблок.** – знак **"X"** в данном поле говорит о том, что проведение операций по инструменту недоступно
- Спрос** – лучшая котировка на покупку
- Предложение** – лучшая котировка на продажу
- П.Спрос** – лучшая индикативная котировка на покупку

П.Предл	– лучшая индикативная котировка на продажу
Пред.св.взв.	– средневзвешенная цена предыдущих торгов
Открытие	– цена открытия торговой сессии по инструменту
Макс.	– наибольшее значение цены сделки за текущую сессию по данному инструменту
Мин.	– наименьшее значение цены сделки за текущую сессию по данному инструменту
Посл.	– цена последней заключенной сделки
Средн.	– средневзвешенная цена сделок за текущую сессию по данному инструменту
Посл.кол-во	– количество инструмента по последней заключенной сделке
Посл.объем	– объем последней заключенной сделки, в установленной валюте
Общее кол-во	– суммарное количество инструмента по всем заключенным сделкам
Общий объем	– суммарный объем всех сделок, в установленной валюте
Заявки	– количество заявок, поданных участниками
Сделки	– количество сделок, заключенных участниками
Фирмы-заявки	– количество участников, подававших заявки
Фирмы-сделки	– количество участников, заключивших сделки
ОП	– лимит открытых позиций (срочные контракты)
Погашение	– дата погашения облигации
Дней до пог.	– количество дней, оставшихся до прекращения обращения инструмента
Посл.цена пр.дня	– цена последней сделки, заключенной в предыдущий результативный торговый день
Изм.к пред.дню	– процентное соотношение цены текущего результативного торгового дня по отношению к последней цене предыдущего результативного торгового дня
Дата посл. сделки	– дата последней заключенной сделки, зарегистрированной в торговой системе Биржи по данному инструменту
Уч-ки за 30 дней	– количество членов Биржи, заключавших сделки методом открытых торгов по финансовому инструменту за последние 30 рабочих дней, предшествующих текущему рабочему дню

Если торги по инструменту закрыты (состояние "**С**"), параметры, касающиеся торгов, отражают данные на момент закрытия торгов. Прямые сделки и сделки репо не включаются в подсчет количественных параметров торгов; для этого используется информация только по сделкам, заключенным методом открытых торгов.

Значения в столбцах финансовых инструментов меняются на экране в ходе торгов. Для удобства и быстроты восприятия информации факт заключения сделки показывается выделением строки инструмента цветом на несколько секунд.

Зеленым цветом	– сделка совершена по цене выше цены последней сделки
Красным цветом	– сделка совершена по цене ниже цены последней сделки

Синим цветом

– сделка совершена по цене равной цене последней сделки

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном инструменте открывает доступ к следующим функциям:

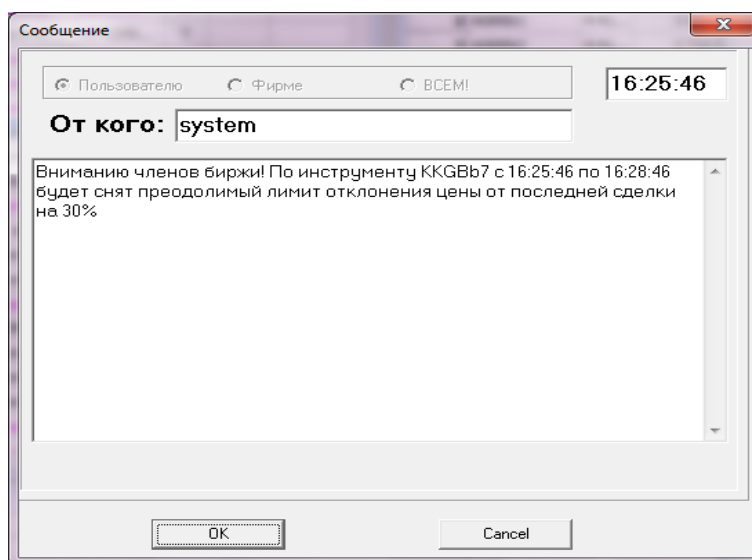
- **"Сделки" (Alt+1), "Заявки" (Alt+2)** – просмотр в соответствующих окнах сделок и активных заявок по инструменту;
- **"Котировки" (Ctrl+Enter (двойной щелчок мыши), Alt+3)** – переход в окно **"Котировки"**;
- **"Неактивные заявки" (Alt+4)** – переход в окно **"Неактивные заявки"**, в котором находятся заявки пользователя, снятые или удовлетворенные в ходе торгов по инструменту;
- **"Прямые котировки" (Alt+5)** – переход в окно **"Прямые котировки"**, содержащее индикативные котировки участников торгов по инструменту;
- **"История торговых сессий" (Alt+6)** – переход в окно **"История торговых сессий"**;
- **"Транзитный приказ" (Ctrl+4)** – подача Интернет-клиентом транзитного приказа по данному инструменту;
- **"Подключить" (Ctrl+Enter), "Отключить" (Ctrl+6)** – активирование либо деактивирование инструмента;
- **"Дать права..." (Ctrl+8)** – используется для предоставления прав пользователям;
- **"Закрытое размещение" (Ctrl+9)** – самостоятельное открытие закрытого размещения/выкупа данного инструмента оператором;
- **"Открыть торги (вторичное разм.)" (Ctrl+0)** – самостоятельное открытие торгов данным инструментом оператором;
- **"Снять заявки"** – самостоятельное снятие/удаление заявок по данному инструменту оператором;
- **"Открыть предв. фиксинг"** – самостоятельное открытие предварительного приема заявок по данному инструменту, проводимого методом фиксинга, оператором, и затем открытие торгов, проводимых методом фиксинга;
- **"Открытое размещение"** – самостоятельное открытие открытого размещения/выкупа по данному инструменту оператором.
- **"График"** – просмотр графиков по данному инструменту; описание действий приведено в главе **"Графики"**;
- **"Добавить в Избранные инструменты"** – функция, позволяющая пользователю в любой момент времени добавить часто используемые финансовые инструменты в избранные; описание действий приведено в пункте **"Избранные финансовые инструменты"**;
- **"Свойства" (Alt+Enter)** – при выборе на экране появляется окно **"Параметры инструмента"**, которое дает пользователю информацию об опциях инструмента без прав на модификацию;
- **"Подать заявку" (Ctrl+1)** – подача заявки, если торги по инструменту открыты;
- **"Закрыть торги" (Ctrl+9)** – самостоятельное закрытие торгов по данному инструменту оператором;
- **"Приостановить" (Ctrl+0)** – самостоятельное приостановление торгов по данному инструменту оператором;
- **"Продолжить" (Ctrl+0)** – самостоятельное продолжение торгов по данному инструменту оператором;

- **"Удалить"** (Del) – самостоятельное удаление данного инструмента оператором.

По просьбе участников торгов оператором может быть снят лимит отклонения цены в заявке от цены последней сделки. Для этого оператору необходимо кликнуть правой клавиши "мыши" на выбранном инструменте и выбрать следующую функцию:

- **"Снять лимит"** – самостоятельное снятие оператором лимита отклонения цены в заявке от цены последней сделки. После чего лимит автоматически снимается, и при подаче заявок учитываться не будет. По истечении трех минут действие лимита автоматически возобновляется.

В случае выбора оператором опции "Снять лимит" все участники торгов оповещаются об этом посредством следующего сообщения:



Опции в окне **"Параметры инструмента"** могут зависеть от рынка, к которому принадлежит инструмент.

Закладка **"Основные"** содержит следующие опции:

- | | | |
|---------------------------------------|---|---|
| Рынок | – | определение инструмента в иерархии объектов торговой системы Биржи |
| Сектор | – | код для связи с внешними системами (национальный идентификационный номер (НИН), если это ценная бумага) |
| Группа | – | |
| Внешний код | – | |
| Заблокирован | – | при включении торговля по инструменту запрещается |
| Есть маркет-мейкеры | – | при включении по инструменту могут выставлять котировки только маркет-мейкеры |
| Мин. объем для маркет-мейкеров | – | при включенной опции "есть маркет-мейкеры" редактируется поле, определяющее минимальное количество инструмента для обязательной котировки маркет-мейкера – неделимый лот |

Закладка **"Дополн."** содержит:

- | | | |
|------------------------|---|--|
| Есть доходность | – | при включении система будет осуществлять |
|------------------------|---|--|

		расчет доходности по инструменту
Дата текущей сессии	–	поле, в котором указана дата текущей сессии
Группа для расчета рыночной цены	–	порядковый номер группы для расчета рыночной цены
Дата открытия/закрытия	–	даты открытия и закрытия обращения финансового инструмента
Номер текущей сессии	–	порядковый номер текущей сессии по инструменту на текущий день, начиная с нуля
Срок репо для автоматического репо, дней	–	количество дней операции репо для инструментов рынка "автоматического" репо
Дней до погашения	–	количество дней, оставшихся до прекращения обращения инструмента
Дней до выплаты	–	количество дней, оставшихся до выплаты купонного вознаграждения по ценной бумаге
Дата прекращения обращения	–	дата прекращения обращения инструмента
		при активации данного элемента торги и расчеты проводятся по схеме T+2, в противном случае по схеме T+0. Есть три признака T+2:
		1. Маржинальная торговля – при активации данного элемента торги и расчеты проводятся с забором частичного обеспечения, в противном случае по схеме с полным преддепонированием денег и бумаг;
		2. Неттинг – сделки, заключенные по данному инструменту проходят клиринг и учитываются в расчетной ведомости, формируемой в день заключения данных сделок. Устанавливается только по тем инструментам, которые добавлены в торговую систему для проведения специальных аукционов при урегулировании дефолтов;
Параметры T+2	–	3. Репо с неттингом – идентифицирует инструменты автоматического репо, по которым залоговые инструменты не блокируются.

Закладка **"Цена"** содержит:

Номинал	–	номинал инструмента; поле используется в информационном аспекте
Оценка	–	оценочная цена для определенных ценных бумаг, являющихся объектами сделок репо на рынке "автоматического" репо

Цена открытия	– цена первой сделки открытия сессии
Средняя цена утренних торгов	– средневзвешенный курс утренней сессии
Предыдущий средневзвешенный курс для утренней сессии	– способ определения средневзвешенной цены для ее отображения в столбце "Пред.ср.взв." окна "Финансовые инструменты"

Закладка **"Позиции"** содержит:

Стандартное количество базового актива	– количество инструмента, принимаемое за единицу при совершении операций в торговой системе Биржи
Кратное количество базовых активов - лот	– количество инструмента в заявке должно быть кратно лоту, за исключением прямых заявок
Минимальное кол-во инструментов в заявке	– количество инструмента в заявке должно быть не меньше данного значения; при нулевом значении – не меньше лота
Максимальное количество инструментов в заявке	– при включенной опции количество инструмента в заявке должно быть не больше данного значения
Ставка деп. маржи по спред.позиции/изол.позиции	– используются только для срочных контрактов с целью определения маржевых ставок

Закладка **"Заявки"** содержит:

Скрытое количество разрешено Приобретенное кол-тво не доступно до расчетов по сделке Заявки сохраняются до указанной в них даты	– при включенной опции разрешения скрытого количества в лимитированных заявках можно указать количество и скрытое количество; при этом в котировках отображается только количество; при его удовлетворении, система формирует еще одну аналогичную заявку с тем же количеством. Данный процесс продолжается, пока не будет удовлетворено все скрытое количество заявки. При следующей включенной опции трейдер, купивший инструмент, не сможет его продать до осуществления расчетов по сделке на покупку. Последняя опция позволяет устанавливать дату истечения срока действия заявки
Количество равно объему	– при включенной опции объем заявки или сделки равен их количеству; применяется, например, при размещении облигаций по ставке доходности
Для франкф.или открытого аукциона	– указывается время принудительного завершения франкфурта или открытого аукциона

Разрешены заявки	– указываются типы разрешенных заявок и их направление
Обратное ранжирование	– при включенной опции осуществляется обратное ранжирование цен котировок и автоматически отключается поле доходности. Данная опция может применяться при торговле облигациями по ставке доходности
Объем выч. из доходности	– при включенной опции объем заявки или сделки вычисляется из ставки доходности
Закладка " Лимиты " содержит:	
Проверка позиции по деньгам	– опции, позволяющие осуществлять проверку лимитов по денежным и позиционным счетам
Проверка позиций по INSTR.	– Опции, позволяющие осуществлять проверку лимитов только по ценным бумагам
Разрешены сделки с одним счетом	– опция, разрешающая сделки по одному и тому же торговому счету (продавец и покупатель – одно лицо)
Отображать точность цены	– количество знаков после запятой
Минимальный шаг изменения цены	– минимальный шаг изменения цены, в установленной валюте
Лимит отклонения от последнего значения средневзвешенной цены более чем на	– лимит отклонения цены в заявке от предыдущей средневзвешенной цены, в процентах
Предельное отклонение от цены последней сделки	– лимит отклонения цены в заявке от цены последней сделки, в процентах
Лимит на долю рынка в процентах	– лимит на долю рынка определяет максимально допустимую долю позиций, открытых на одном позиционном счете, в общем числе позиций, открытых по инструменту на всех позиционных счетах. Применяется на срочном рынке
Макс. ОП вне лимита на долю рынка	– доступная открытая позиция без учета лимита на долю рынка
Предупреждение при отклонении от последнего значения средневзвешенной цены более чем на	– лимит, устанавливаемый оператором для предупреждения при отклонении цены в заявке от последнего значения средневзвешенной цены, в процентах
Предупреждение при отклонении от лучшей цены покупки более чем на	– лимит, устанавливаемый оператором для предупреждения при отклонении цены в заявке от лучшей цены покупки, в процентах

Предупреждение при отклонении от лучшей цены продажи более чем на – лимит, устанавливаемый оператором для предупреждения при отклонении цены в заявке от лучшей цены продажи, в процентах

Нулевые значения лимитов означают отсутствие действия таких лимитов.

Закладка **"Валюты"** содержит опции для расчета сумм сделок по инструментам, номинированных в установленной валюте, и определения данных для расчета накопленного интереса и доходности, в случае если инструмент является купонной ценной бумагой. Опции закладки (например, по купонной ценной бумаге) означают:

Валюта, в которой ведутся торги
Валюта, в которой производятся расчеты – выбор валюты для проведения торгов и расчетов

Способ пересчета – курс, по которому будет пересчитана сумма сделки при ее расчете в установленной валюте (например, по инструментам, торговля которыми проводится в долларах США, а расчеты – в тенге); если по сделке дата проведения расчета отличается от текущей даты, пересчет не осуществляется

Курс пересчета – **"установленный курс"** – официальный курс Национального Банка Республики Казахстан или иной курс, определяемый по алгоритму, который описан в нормативных документах Биржи, по отношению к валюте, в которой ведутся торги, (смотрите пункт **"Валюты"**).

"Курс Биржи" – средневзвешенный курс Биржи на утренней сессии по валюте, в которой ведутся торги


метод определяет, по какой базе осуществляется расчет доходности и накопленного интереса по ценной бумаге.

"Actual/365", **"30/360"**, **"Actual/360"** являются стандартами, применяемыми на практике.

Метод – **"Actual/364"** предполагает для расчета реальное количество дней между выплатами с базой 364 дня.

По купонным бумагам принято осуществление выплаты купона через каждые 182 дня.

"Act/(182-183)" означает, что расчет осуществляется по схеме **"Actual/365"** с условием выплаты купона на 182^й и 183^й день каждого года обращения

База дат	<ul style="list-style-type: none"> – при включении данной опции расчет доходности и накопленного интереса по ценной бумаге осуществляется точно по фактическим датам, имеющимся в базе дат. Кнопка  позволяет оператору загрузить базу дат из бэк-офисных приложений
Купонная бумага	<ul style="list-style-type: none"> – ценная бумага, по которой владельцу выплачивается не только номинальная стоимость в момент погашения, но и (периодическое) купонное вознаграждение (купон)
Дней в интервале	<ul style="list-style-type: none"> – количество дней в интервале между выплатами купона
Дней с посл. выплаты	<ul style="list-style-type: none"> – количество дней со дня последней выплаты купона
Накопл. интерес	<ul style="list-style-type: none"> – сумма купона в процентах; значение купона при расчете объема торговой системой Биржи не округляется, но отображаются только 4 знака после запятой
Курс на дату начала обращения	<ul style="list-style-type: none"> – курс на дату начала обращения индексированной ценной бумаги
Дата с которой не нач. НИ	<ul style="list-style-type: none"> – дата, с которой торговой системой Биржи не осуществляется расчет накопленного интереса
Время с которой не нач. НИ	<ul style="list-style-type: none"> – время, с которой торговой системой Биржи не осуществляется расчет накопленного интереса
Купонная ставка, %	<ul style="list-style-type: none"> – величина, соответствующая ежегодным процентным выплатам к номинальной стоимости по купонным бумагам. Это ставка процента, выплачиваемая эмитентом купонного займа владельцу купонной бумаги
Количество выплат в году	<ul style="list-style-type: none"> – величина, указывающая на количество выплат в году по данному инструменту
Дата посл. выплаты	<ul style="list-style-type: none"> – дата последней выплаты купонного вознаграждения
Дата след. выплаты	<ul style="list-style-type: none"> – дата следующей выплаты купонного вознаграждения

Закладка "**Swift**" содержит два поля, которые требуются при расчете объема заявки или сделки:

Коррекция количества в SWIFT-сообщении	<ul style="list-style-type: none"> – значение, на которое будет умножено количество
Коррекция цены в SWIFT-сообщении	<ul style="list-style-type: none"> – значение, на которое будет умножена цена
Делитель кол-ва в SWIFT-сообщении	<ul style="list-style-type: none"> – значение, на которое будет разделено количество

(для торговли паями делитель должен иметь значение 1 000 000)

Закладка **"Параметры маржирования"** отображается только при активной опции "маржинальная торговля" и содержит:

Расчетная цена	– рассчитывается как рыночная цена в соответствии с действующей методикой оценки
Ставка начальной маржи	– ставка маржевого взноса в процентах и валюте торгов. Устанавливается оператором
Верхняя граница	– ставка верхнего лимита изменения цены (в процентах и долях единицы)
Нижняя граница	– ставка нижнего лимита изменения цены (в процентах и долях единицы)


4.5. Избранные финансовые инструменты

Для удобного и оперативного доступа к наиболее часто торгуемым финансовым инструментам в терминале создано отдельное пользовательское окно – **"Избранные финансовые инструменты"**.²

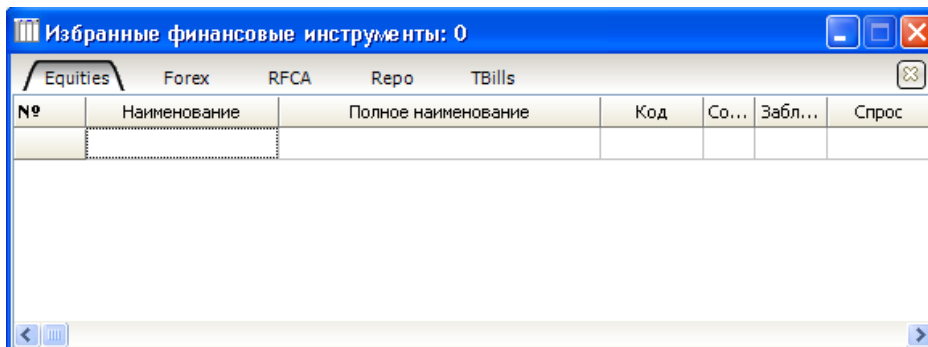
В окне **"Избранные финансовые инструменты"** пользователь может создать свой список финансовых инструментов со структурой, упорядоченной по типам и видам инструментов, что делает совершение операций с предпочитаемыми пользователем финансовыми инструментами более удобным.

В окне **"Избранные финансовые инструменты"** можно совершать все операции, аналогичные тем, что пользователь может совершать в окне **"Финансовые инструменты"**.

Открыть окно **"Избранные финансовые инструменты"** можно следующими способами:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр" – "Избранные инструменты"**;
- нажатием клавиш **Alt+S**;
- нажатием кнопки  на панели управления.

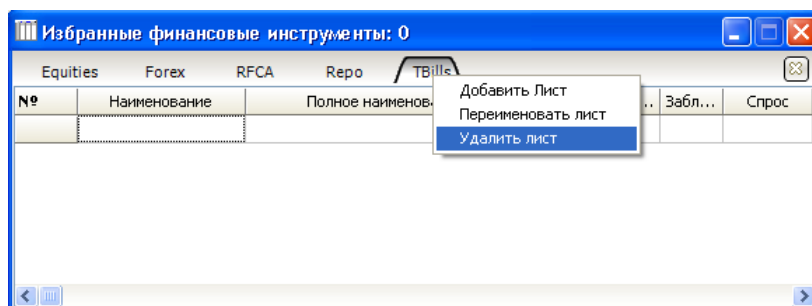
По умолчанию в окне уже имеется набор вкладок, которые пользователь может переименовать либо создать дополнительные вкладки на свое усмотрение.



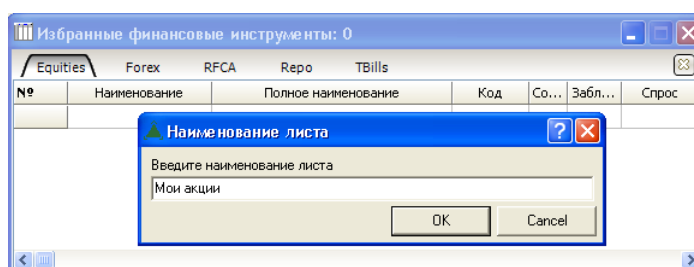
² Название окна на английском языке – "Selected financial instruments".

Редактирование вкладок

Нажатием правой клавиши "мыши" на выбранной вкладке пользователь может: добавлять новый лист (далее – вкладка), переименовать или удалить выбранную вкладку:



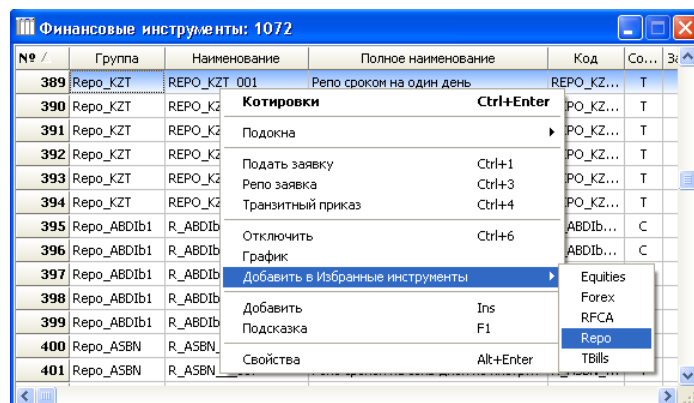
Переименование вкладки:



Выбор инструментов

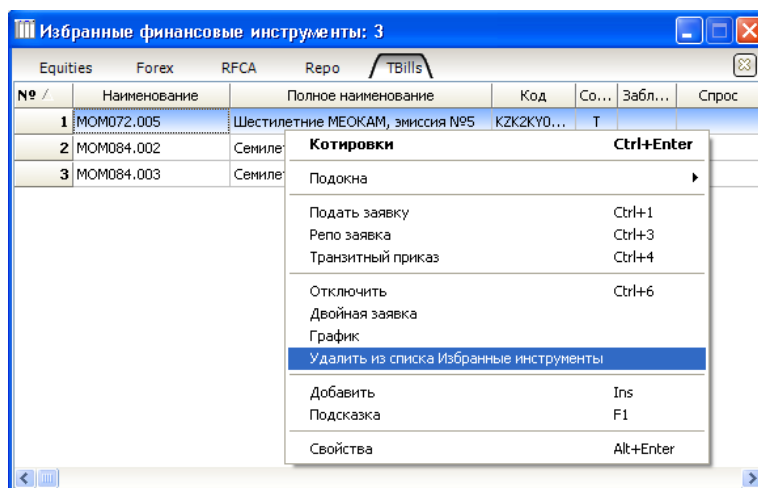
Выбор инструментов происходит следующим образом: щелкнув правой клавишей "мыши" по выбранному инструменту в окне **"Финансовые инструменты"**, выбрать опцию **"Добавить в избранные инструменты"** и указать вкладку, в которую пользователь добавляет инструмент.

Добавить финансовый инструмент в окно **"Избранные финансовые инструменты"** можно только один раз. Если в окне **"Финансовые инструменты"** эта функция для какого-либо финансового инструмента недоступна, это означает, что данный инструмент уже присутствует в одной из вкладок окна **"Избранные финансовые инструменты"**.



Удаление инструментов из окна "Избранные финансовые инструменты"

Убрать инструмент из окна **"Избранные финансовые инструменты"** можно в окнах **"Финансовые инструменты"** или **"Избранные финансовые инструменты"**, выбрав инструмент и нажав правой клавишей "мыши" выбрав опцию **"Удалить из списка избранные инструменты"** (при этом инструмент сохраняется в списке инструментов в окне **"Финансовые инструменты"**).



4.6. История торгов

В окне **"История торговых сессий"** представлена статистическая информация о торговых сессиях по выбранному финансовому инструменту за текущий день. Окно **"История торговых сессий"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню пункт **"Просмотр" – "История торговых сессий"**;
- открыв окно **"Финансовые инструменты"** – нажатием правой клавиши "мыши" пункта **"История торговых сессий"** ("горячая" клавиша **Alt+6**).

В заголовке окна **"История торговых сессий"** указывается номер финансового инструмента, который соответствует порядковому номеру инструмента в окне **"Финансовые инструменты"**.

№ /	Дата	Инструмент	Тип	Время откр.	Время закр.	Заявки	Сделки	Фирмы-заявки	Фирмы-сделки	Открытие	First	First Qty	Посл.	Посл. кол-во
276	07.09.2009	HSBKp1	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
277	07.09.2009	KKGВр	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
278	07.09.2009	KZTKр	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
279	07.09.2009	NRBN	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
280	07.09.2009	TEBN	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
281	07.09.2009	TEBНр	T	11:30:02	--:--	0	0	0	0			0		0
282	07.09.2009	CSBНр	T	15:00:01	--:--	0	0	0	0			0		0
283	07.09.2009	HSBKр	T	15:00:01	--:--	0	0	0	0			0		0

В окне **"История торговых сессий"**, кроме столбцов, аналогичных столбцам окна **"Финансовые инструменты"**, содержатся также следующие столбцы:

- Дата** – дата открытия сессии
- Инструмент** – код инструмента
- Тип** – статус торгов:
"A", **"U"** – размещение или выкуп (метод специализированных торгов)
"C" – торги закрыты
"F" – торги проводятся методом франкфуртского аукциона
"P" – открыт предварительный прием заявок (метод непрерывного встречного аукциона)
"T" – торги открыты (метод непрерывного встречного аукциона, метод заключения прямых сделок)
"t" – торги приостановлены

"X" – торги открыты (метод фиксинга)

"x" – открыт предварительный прием заявок (метод фиксинга)

Время откр.	– время открытия сессии
Время закр.	– время закрытия сессии
First	– цена первой сделки
First Qty	– количество инструмента первой сделки
Мин. Кол-во	– количество инструмента по минимальной цене
Макс. Кол-во	– количество инструмента по максимальной цене
Рыночная цена	– цена отсечения, определенная при проведении размещения или выкупа методом франкфуртских торгов
Заявки	– количество заявок за данную торговую сессию
Сделки	– количество сделок за данную торговую сессию
Mkt Prc Qty	– суммарное количество инструмента по всем заключенным сделкам при проведении размещения или выкупа методом франкфуртских торгов
Mkt Prc Vol	– суммарный объем по всем заключенным сделкам при проведении размещения или выкупа методом франкфуртских торгов

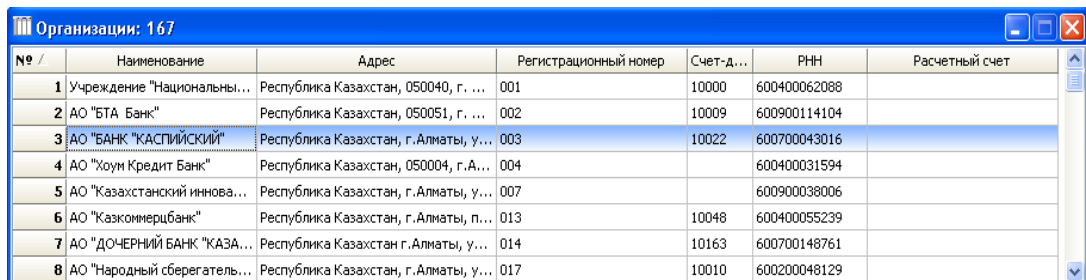
Нажатие правой кнопки "мыши" открывает доступ к следующим функциям:

- **"Закрыть сессию" (Ctrl+1)** – данная функция позволяет оператору закрыть текущую сессию.

4.7. Организации

В окне **"Организации"** представлен полный перечень организаций, допущенных к работе с торговой системой Биржи, с содержанием сведений об их официальном наименовании и иных реквизитах. Окно **"Организации"** открывается следующими способами:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Участники" – "Организации"**;
- нажатием "горячей" клавиши **Ctrl+O**.



№ /	Наименование	Адрес	Регистрационный номер	Счет-д...	РНН	Расчетный счет
1	Учреждение "Национальны...	Республика Казахстан, 050040, г. ...	001	10000	600400062088	
2	АО "БТА Банк"	Республика Казахстан, 050051, г. ...	002	10009	600900114104	
3	АО "БАНК "КАСПИЙСКИЙ"	Республика Казахстан, г. Алматы, у...	003	10022	600700043016	
4	АО "Хоум Кредит Банк"	Республика Казахстан, г. Алматы, у...	004		600400031594	
5	АО "Казахстанский иннова...	Республика Казахстан, г. Алматы, у...	007		600900038006	
6	АО "Казкоммерцбанк"	Республика Казахстан, г. Алматы, п...	013	10048	600400055239	
7	АО "ДОЧЕРНИЙ БАНК "КАЗА...	Республика Казахстан г. Алматы, у...	014	10163	600700148761	
8	АО "Народный сберегатель...	Республика Казахстан, г. Алматы, у...	017	10010	600200048129	

Столбцы окна:

Наименование	– полное наименование организации
Адрес	– адрес организации

- Регистрационный номер** – регистрационный номер, присваиваемый Биржей
- Счет-депо** – лицевой счет депонента, открытый в Центральном депозитарии,
- РНН** – РНН организации
- Расчетный счет** – расчетный счет организации
- Запрещен удал.доступ** – при включенной опции данная организация не может принимать участие в торгах в режиме удаленного доступа

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном инструменте открывает доступ к функциям:

- **"Добавить"** (**Ins**) – используется операторами для добавления организации в список;
- **"Удалить"** (**Del**) – используется операторами для удаления организации из списка;
- **"Свойства"** (**Alt+Enter**) – при выборе на экране появляется окно **"Организация"**, которое дает пользователю полную информацию по выбранной организации без прав на модификацию, а также дополнительно параметры T+2:

Недобросовестный участник – данный признак свидетельствует о допущении дефолта участником торгов. Участник не имеет возможности подавать заявки в ТС, направленные на увеличение его МВОП (максимально возможной открытой позиции), при этом он продолжает исполнение им существующих обязательств;

Позиция МСПД – при активизации данного элемента организации добавляются еще два позиционных денежных счета на собственном торговом счете участника: "KZT(МСПД)" и "KZT(клиентский счет МСПД)".

4.8. Фирмы

В окне **"Фирмы"** представлен перечень фирм – членов Биржи, допущенных к работе с торговой системой Биржи. Окно **"Фирмы"** открывается следующими способами:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Участники" – "Фирмы"**;
- нажатием "горячей" клавиши **Ctrl+F**.

№ /	Наименование	Организация	Рег. № фирмы
1	ABNAA	АО "ООИУПА "GRANTUM Asset Management" (дочерняя организац...	AC00131000000
2	AFBN_	АО "Банк "Астана-финанс"	AC00057000000
3	AK_AL	Исполнительный орган (акимат) города Алматы Республики Каз...	
4	ALASH	АО "Банк "Bank RBK"	AC00007000000
5	ALB__	АО "Альянс Банк"	AC00016000000
6	ALFAB	АО Дочерний Банк "Альфа-Банк"	AC00046000000
7	ALHIL	АО "Исламский Банк "Al Hilal"	AC00306000000
8	ALIBI	АО "Алиби Секьюритиз"	AC00147000000

Столбцы окна:

- Наименование** – краткое наименование фирмы в торговой системе Биржи
- Организация** – организация, к которой данная фирма относится
- Рег. № фирмы** – регистрационный номер, присваиваемый Биржей для идентификации в системе
- Фирма - клиринговый член по срочным контрактам** – отметка "клиринговый член" участника торгов по срочным контрактам

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной фирме делает доступными функции:

- **"Пользователи" (Ctrl+Enter)** – выводится список пользователей фирмы
- **"Права" (Alt+1)** – используется для предоставления прав фирме. Более подробная информация представлена в главе 5 настоящего Руководства;
- **"Послать сообщение" (Ctrl+1)** – отправить сообщение всем пользователям фирмы;
- **"Открыть таблицу обяз. котировок" (Ctrl+2)** – просмотр обязательных котировок выбранной фирмы;
- **"Добавить" (Ins)** – используется для добавления фирмы;
- **"Удалить" (Del)** – используется для удаления фирмы;
- **"Свойства" (Alt+Enter)** – при выборе на экране появляется окно **"Фирма"**, в котором содержится информация о фирме. В случае если фирма является клиентом (физическим лицом), ставится флаг **"Физическое лицо"**. Опции **"STrade"** и **"MTrade"** предоставляют доступ к терминалам интернет и мобильного трейдинга соответственно.

4.9. Пользователи

В окне **"Пользователи"** в виде таблицы представлен полный список пользователей, допущенных к работе с торговой системой Биржи. Окно **"Пользователи"** открывается следующими способами:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Участники" – "Пользователи"**;
- нажатием "горячей" клавиши **Ctrl+U**.

№ /	ID	IP адрес	Со...	Пароль установ...	SSL	Акт. пар...	Квалиф.с...	Модуль обмена	Скорость	Время отклика	Зарегистрирован	Регистратор	Контрагент	Пользователь	Организация
1	admin		D	15.06.2014	-	+	...				29.01.2014 17...	root	-	-	-
2	reger		D	17.09.2014	+	+	...		437.4902		14.05.2014 14...	root	-	-	-
3	reger2		D	22.09.2014	+	+	...				22.05.2014 11...	root	-	-	-
4	AS004		D	03.12.2009	+	+ 00:00...		Клиенты ASYL	AS004	-
5	AS035		D	03.12.2009	+	+ 00:00...		Клиенты ASYL	AS035	-
6	AS039		D	08.10.2012	+	+ 00:00...		Клиенты ASYL	AS03	-
7	AS040		D	17.08.2010	+	- 00:00...		Клиенты ASYL	AS040	-
8	AS042		D	15.06.2014	+	+ 00:00...		Клиенты ASYL	AS042	-

Столбцы окна:

- ID** – идентификатор пользователя в торговой системе Биржи; – первые два или три значения – идентификатор организации пользователя

IP адрес	– IP-адрес локального компьютера пользователя (доступно только оператору)
	состояние подключения пользователя (выделятся цветом): "D" – клиент не подключен к серверу (серый)
Сост.	– "L" – подключен через компьютер локальной сети в торговом зале Биржи (синий) "R" – подключен в удаленном режиме (зеленый)
Пароль установлен	– дата установки пароля
	состояние подключения по типу соединения:
SSL	– "+" – SSL – соединение "-" – TCP – соединение
	состояние активации пароля:
Акт. пароль	– "+" – пароль активирован "-" – пароль не активирован
Квалиф. срок	– дата истечения квалификационного свидетельства, выдаваемого участнику торгов
	состояние подключения модуля обмена:
Модуль обмена	– "+" – данный пользователь подключен к модулю обмена
Скорость	– количественное выражение скорости подключения пользователя к торговой системе Биржи, в Кбит/сек
Время отклика	– количественное выражение времени отклика между сервером торговой системы Биржи и терминалом, в секундах
Зарегистрирован	– дата регистрации пользователя в торговой системе Биржи
Регистратор	– Идентификатор регистратора
Контрагент	– краткое наименование фирмы пользователя
Пользователь	– имя, фамилия, отчество пользователя
Организация	– наименование организации пользователя системы подтверждения

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном пользователе делает доступными функции:

- **"Права" (Alt+1)** – используется для предоставления прав пользователю. Более подробная информация предоставлена в главе **"Права"**;
- **"Послать сообщение" (Ctrl+1)** – отправить сообщение выбранному пользователю;
- **"Продлить срок действия пароля" (Ctrl+7)** – используется для продления пароля (сроком на 3 дня);
- **"Генерировать ключи" (Ctrl+8)** – используется для генерации ключей пользователя;
- **"Установить пароль" (Ctrl+9)** – используется для активации пароля пользователя;
- **"Добавить" (Ins)** – используется для добавления пользователя;
- **"Удалить" (Del)** – используется для удаления пользователя;

- **"Свойства"** – (Alt+Enter) – оператор может редактировать свойства пользователя.

The screenshot shows a dialog box titled "Пользователь" (User) with the following fields and options:

- Тип пользователя:** Radio buttons for "Трейдер", "Оператор", "Подтвержд.", "i-Клиент", "Брокер", and "Регистратор". "i-Клиент" is selected.
- Фирма:** Text field containing "Клиенты ASYL".
- ID:** Text field containing "AS054".
- Имя пользователя:** Text field containing "AS054".
- Пароль установлен:** Text field containing "14".
- Дней до изменения:** Text field containing "6".
- Year:** Text field containing "2011".
- Expiration:** Text field containing "-1184".
- Только SSL**
- Генерить ключи этому пользователю**
- Срок истечения сертификата:** Three empty text fields.
- Уст. собств. лимитов**
- Модуль обмена**
- Зарегистрирован:** Text field containing "0".
- Регистратор:** Text field containing "0".
- Способы подключения:**
 - Терминал**
 - STrade**
 - Библ. доступ**
 - FIX**
 - MTrade**


Buttons at the bottom: OK, Cancel, Help.

- | | |
|-------------------------|--|
| Тип пользователя | – пользователь торговой системы Биржи |
| Трейдер | – сотрудник члена Биржи, имеющий полномочия на совершение определенных действий в торговой системе Биржи от имени данной организации |
| Оператор | – сотрудник Биржи, имеющий полномочия на совершения определенных действий в торговой системе Биржи от имени Биржи |
| Подтвержд. | – сотрудник члена Биржи, являющийся участником системы подтверждения и имеющий полномочия на совершение определенных действий в торговой системе Биржи от имени данной организации |
| i-Клиент | – клиент брокера (физическое или юридическое лицо), имеющий полномочия на совершения определенных действий в торговой системе Биржи от своего имени |

Брокер	–	сотрудник члена Биржи, имеющий полномочия на совершения определенных действий (в том числе по обслуживанию i-Клиентов) в торговой системе Биржи от имени данной организации
Регистратор	–	сотрудник Биржи, имеющий полномочия добавлять/удалять пользователей
Фирма	–	код фирмы
ID	–	идентификатор пользователя
Пароль установлен	–	дата установления пароля для входа в терминал
Дней до изменения	–	остаток дней до изменения текущего пароля
Имя пользователя	–	фамилия имя отчество участника торгов в торговой системе Биржи
Генерить ключи этому пользователю	–	опция, позволяющая оператору произвести генерацию ключей выбранного пользователя
Только SSL	–	опция устанавливается для тех пользователей, работающих в торговой системе Биржи с использованием только i-Key токена (USB ключа) или ключевого файла
Admin	–	данная опция позволяет брокеру создавать объекты в торговой системе Биржи от имени своей организации для i-клиентов
Срок истечения квалификац. свидетельства	–	дата истечения квалификационного свидетельства, выдаваемого участнику торгов
Установ. собственных лимитов	–	установка собственных лимитов отклонения цены опционально пользователем для предотвращения ввода некорректной цены в заявку. Собственные лимиты могут устанавливаться пользователями участника торгов, имеющими право на их изменение. Право на изменение собственных лимитов предоставляется маклером биржи тем или иным пользователям участника торгов на основе письменного заявления данного участника торгов и устанавливается маклером биржи в свойствах данного пользователя.
Модуль обмена	–	позволяет внешним программам участников торгов получить текущую информацию о параметрах финансовых инструментов, котировках, сделках, заявках, а также осуществлять подачу заявок в торговую систему Биржи.
Способы подключения	–	указываются способы подключения к торгам (терминал, STrade, MTrade, FIX, библиотека доступа)

4.10. Торговые счета

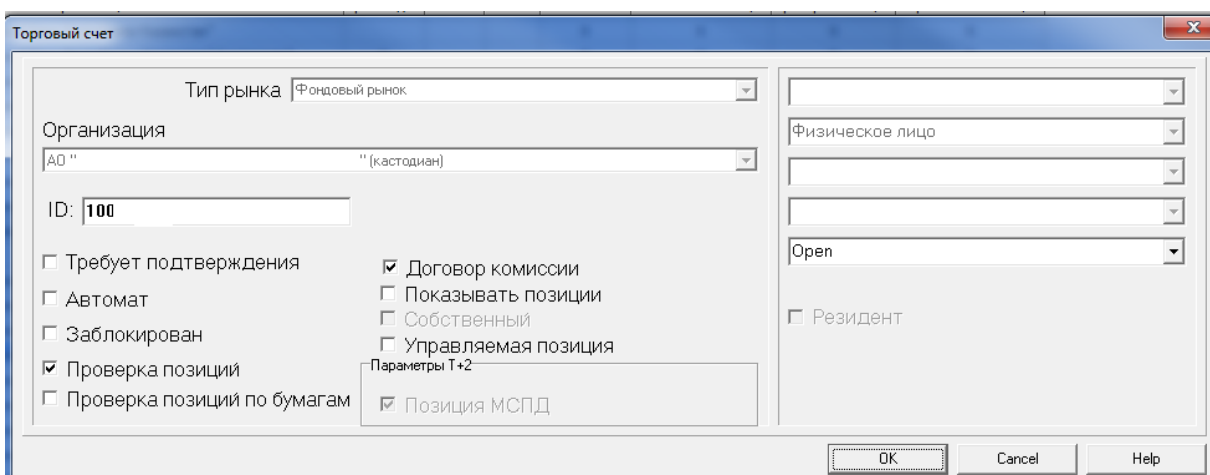
В окне **"Торговые счета"** представлен полный список торговых счетов. Окно **"Торговые счета"** открывается следующими способами:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Участники" – "Торговые счета"**;
- нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+X**;
- выбором на панели инструментов соответствующего значка .

№	Наименование	Организация	Треб.подтв.	Авто...	Забл...	Собственн...	Показывать пози...	Проверка пози...	Управляемая позиция	Статус СПС(Т+2)	Единый Лимит
36	1002100209	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
37	1002100210	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
38	1002100211	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
39	1002100212	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
40	1002100213	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
41	1002100215	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
42	1002100216	АО "Банк ЦентрКре...						X			0.00
43	1002130007	АО "Банк ЦентрКре...	X					X			0.00

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном торговом счете вызывает следующие функции:

- **"Позиционные счета" (Ctrl+Enter)** – просмотр позиционных счетов данного торгового счета;
- **"Добавить" (Ins)** – позволяет добавить торговый счет
- **"Удалить" (Del)** – позволяет удалить торговый счет
- **"Свойства" (Alt+Enter)** – просмотр свойств торгового счета.



Доступны следующие свойства торгового счета:

- **"Автомат"**. Для подачи заявок интернет-клиентом без подтверждения со стороны брокера следует поставить галочку на данном свойстве. Редактирование данного свойства возможно самим пользователем.
- **"Заблокирован"**. Галочка на данном свойстве указывает на то, что счет заблокирован, операции по счету невозможны. Редактирование данного свойства возможно только оператором.
- **"Проверка позиций"**. Галочка на данном свойстве указывает на осуществление проверки позиций по счету. Галочки установлены на всех счетах за исключением счетов на валютном и срочном рынке. Редактирование данного свойства возможно только оператором.
- **"Проверка позиций по бумагам"**. Галочка на данном свойстве указывает на осуществление проверки позиций по ценным бумагам.


- **"Договор комиссии"**. Галочка на данном свойстве подтверждает наличие договора комиссии между брокером и его клиентом и активирует клиентский субсчет.
- **"Показывать позиции"**. Для отображения позиций пользователя по торговому счету следует поставить галочку на данном свойстве. Редактирование данного свойства возможно самим пользователем. В случае отсутствия данной галочки, позиции на позиционном счете не будут видны пользователю.
- **"Собственный"**. Галочка на данном свойстве указывает на то, что данный счет является собственным. Редактирование данного свойства возможно только оператором.
- **"Требует подтверждения"**. Данная галочка указывает на то, что счет принадлежит участнику системы подтверждения. Галочка может быть активирована оператором торговой системы.
- **"Управляемая позиция"**. Галочка на данном свойстве указывает на возможность редактирования пользователем входящей позиции (по деньгам) вручную. Устанавливается для участников торгов первой группы. Редактирование данного свойства возможно только оператором.
- **"Позиция МСПД"**. Галочка на данном свойстве указывает на наличие позиционных счетов для торгов по схеме T+2.

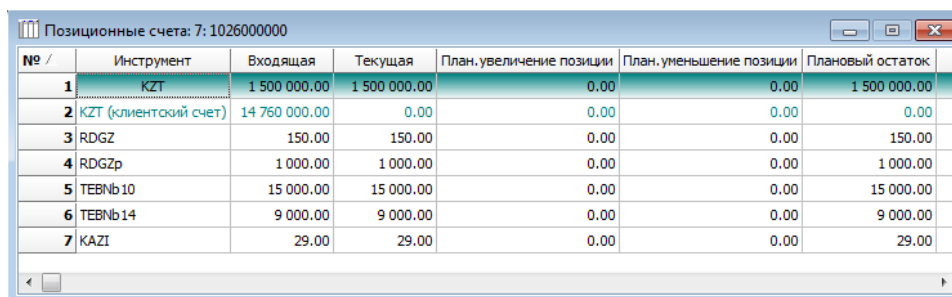
Доступна следующая информация по торговому счету:

- **"Единый лимит"**. Синтетический показатель, выраженный в деньгах и представляющий собой дисконтированную рыночную стоимость портфеля участника торгов за вычетом рыночного риска портфеля. Единый лимит рассчитывается по каждому торговому счету в режиме online. Участник торгов может подавать заявки и заключать сделки по торговому счету до тех пор, пока величина Единого лимита для данного торгового счета остается положительной

4.11. Позиционные счета

Окно **"Позиционные счета"** содержит денежные позиции и позиции по ценным бумагам. Окно открывается следующими способами:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Участники" – "Позиционные счета"**;
- из окна **"Торговые счета"** нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+Enter** либо двойным щелчком мыши;
- нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+P**;
- выбором на панели инструментов соответствующего значка .



№ /	Инструмент	Входящая	Текущая	План.увеличение позиции	План.уменьшение позиции	Планоый остаток
1	KZT	1 500 000.00	1 500 000.00	0.00	0.00	1 500 000.00
2	KZT (клиентский счет)	14 760 000.00	0.00	0.00	0.00	0.00
3	RDGZ	150.00	150.00	0.00	0.00	150.00
4	RDGZp	1 000.00	1 000.00	0.00	0.00	1 000.00
5	TEB№10	15 000.00	15 000.00	0.00	0.00	15 000.00
6	TEB№14	9 000.00	9 000.00	0.00	0.00	9 000.00
7	KAZI	29.00	29.00	0.00	0.00	29.00

Окно **"Позиционные счета"** содержит следующий набор столбцов:

для денег (KZT и KZT (клиентский счет)):

- **"Входящая"** – показывает входящее значение по деньгам, передаваемое АО "Центральный депозитарий ценных бумаг" или устанавливаемое участниками торгов первой группы самостоятельно;

- **"Текущая"** – показывает сумму денег без учета поданных заявок. Рассчитывается как значение поля "Входящая" плюс/минус сумма денег по рассчитанным сделкам;
- **"Плановое увеличение позиции"** – показывает сумму денег в поданных заявках на продажу. Рассчитывается как сумма объемов во всех поданных заявках на продажу. При этом данное поле разделено на 2 части знаком "/". Первая часть поля предназначена для учета заявок, подаваемых в рамках схемы с gross-расчетами и преддепонированием (старая схема), а вторая часть предназначена для учета заявок, подаваемых по инструментам с неттингом;
- **"Плановое уменьшение позиции"** – показывает сумму денег в поданных заявках на покупку. Рассчитывается как сумма объемов во всех поданных заявках на покупку (со знаком минус). В правую часть добавляется размер заявки в деньгах по всем заявкам на покупку, подаваемым по инструментам с неттингом;
- **"Плановый остаток"** – показывает свободную сумму денег. По клиентским торговым счетам рассчитывается как: "Текущая" - "Плановое уменьшение T0" – "МО" – "Блок(T+2)". По собственному торговому счету рассчитывается как: "Текущая" - "Плановое уменьшение T0" – "МО" – "МО (кредит)" – "Блок(T+2);
- **"МО"** – проставляется величина маржевого обеспечения, необходимого под все позиции, маржевое обеспечение по которым забрано деньгами. Т.е. "МО" по денежному счету равно сумме "МО" по инструментальным позиционным счетам;
- **"МО (кредит)"** – отображается та часть величины МО, которая была дана брокером со своего собственного денежного счета клиенту для выполнения требований по маржевому обеспечению. Значение в поле "МО (кредит)" равно сумме таких значений на инструментальных позиционных счетах;
- **"Блок (T+2)"** – в данном поле по денежному счету отображается сумма заблокированного по сделкам с неттингом обеспечения не в виде маржи (при подаче расчетных подтверждений, при заключении нового типа репо), т.е. в данном поле блокируются те активы, которые забираются в размере 100%;
- **"T0"** – сумма объемов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T0;
- **"T1"** – сумма объемов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T1;
- **"T2"** – сумма объемов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T2;
- **"Объем покупки"** – сумма полей "Объем покупки" на инструментальных счетах;
- **"Объем продажи"** – сумма полей "Объем продажи" на инструментальных счетах;

для ценных бумаг (RDGZ ...):

- **"Входящая"** – показывает входящее значение по инструменту, передаваемое АО "Центральный депозитарий ценных бумаг";
- **"Текущая"** – показывает количество инструмента без учета поданных заявок. Рассчитывается как значение поля "Входящая" плюс/минус количество инструмента по рассчитанным сделкам;
- **"Плановое увеличение позиции"** – показывает количество инструмента в поданных заявках на покупку. Рассчитывается как количество инструмента во всех поданных заявках на покупку. Поле разделено на 2 части аналогично денежным счетам;

- **"Плановое уменьшение позиции"** – показывает количество инструмента в поданных заявках на продажу. Рассчитывается как количество инструмента во всех поданных заявках на продажу (со знаком минус). Поле разделено на 2 части аналогично денежным счетам;
- **"Плановый остаток"** – показывает свободное количество инструмента. Рассчитывается как: "Текущая" - "Плановое уменьшение позиции" – "Блок (T+2)";
- **"МО"** – сумма маржевых обеспечений под все поданные заявки/заключенные сделки (величина маржевого обеспечения, необходимого под ту часть данной позиции, которая обеспечена деньгами);
- **"Блок (T+2)"** – количество инструментов, заблокированных в виде маржевого обеспечения;
- **"T0"** – количество финансовых инструментов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T0;
- **"T1"** – количество финансовых инструментов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T1;
- **"T2"** – количество финансовых инструментов по всем сделкам, у которых дата расчетов приходится на день T2;
- **"ТОП"** – текущая открытая позиция клирингового члена по всем заключенным сделкам (использующим деньги в качестве МО) в количестве бумаг ("длинная" – со знаком "плюс", "короткая" – со знаком "минус"). При заключении сделки к текущему значению прибавляется величина, равная количеству в сделке (если сделка на покупку – количество считаем положительным, если на продажу – отрицательным);
- **"Куплено"** – поле разделено на 2 части: значение в левой части равно сумме объемов (в штуках) сделок на покупку без неттинга, значение в правой – с неттингом;
- **"Объем покупки"** – рассчитывается аналогично значению "Куплено", показывает общий объем всех сделок на покупку в деньгах;
- **"Ср.покупки"** – показывает среднюю цену сделок на покупку;
- **"Продано"** – поле разделено на 2 части: значение в левой части равно сумме объемов (в штуках) сделок на продажу без неттинга, значение в правой – с неттингом;
- **"Объем продажи"** – рассчитывается аналогично значению "Куплено", показывает общий объем всех сделок на продажу.
- **"Ср.продажи"** – показывает среднюю цену сделок на продажу.
- **"Нетто/ОП"** – общее количество всех сделок на покупку минус общее количество всех сделок на продажу.
- **"Объем нетто"** – разделено на 2 части аналогично предыдущим полям. Значение левой части поля равно разности между левыми частями полей "Куплено" и "Продано". Правая часть равна разности между правыми частями полей "Куплено" и "Продано";
- **"Статус СПС (T+2)"** – отображается по каждому позиционному счету, имеющему ненулевую величину в поле "Расчетные обязательства". По умолчанию позиция находится в статусе "Ожидает подтверждения". Позиционный счет переходит в статус "Подтверждена", если кастодиан дает расчетное подтверждение. По позиционным счетам, образованным сделками по торговым счетам без системы подтверждения, процедура подтверждения позиций производится автоматически по расписанию.

Остатки на инструментальных позиционных счетах, отображаются как целые числа.

При торговле Паями значение полей на инструментальном позиционном счете отображаются как дробные числа с точностью 6 символов после запятой.

Контекстное меню **"Поменять обеспечение на деньги/бумаги"** на позиционном счете позволяет сменить тип обеспечения активной заявки или заключенной сделки на продажу. Тип маржи по каждой отдельной заявке и сделке отображается в окне "Свойства" соответствующего объекта.

The screenshot shows a trading window for 'KZTO_T2' with the following details:

- Торговый счет: 10307A0004
- Направл.: Покупка, Продажа
- Тип заявки: Лимитированная, Рыночная
- Цена: 1 000.00 (input field: 1000)
- Количество: 1 (input field: 1)
- 1000.0000 (displayed value)
- Обязательная котировка ММ
- Автомат
- Устанавливать периодически заявки: в указанных ценах, в указанных доходностях
- Тип маржи: Бумаги, Деньги (circled in red)
- Buttons: Отмена, Справка

При недостаточности денежного маржевого обеспечения на клиентском счете, недостающая часть маржи по решению брокера может быть заблокирована на собственном счете брокера в поле "Маржевое обеспечение (кредит)".

Брокеру при подаче заявки, в случае недостаточности клиентских средств, демонстрируется окно с указанием размера необходимого кредитования и кнопками для принятия решения "Кредитовать" и "Отмена".

The 'Кредитование' dialog box displays the following information:

- КZTO_T2
- Покупка
- Цена: 1 000.00
- Количество: 1
- Объем: 1 000.00
- Маржевое обеспечение: 200.00
- Объем кредитования: 200.00
- Message: На выбранном клиентском счете недостаточно средств для маржевого обеспечения. Подтвердите кредитование заявки с собственного счета.
- Buttons: Кредитовать, Отмена

4.11.1. Изменение позиционных счетов

Ниже приведен пример заключения сделок по новой (T+2) и старой (T+0) схемам.

Параметры инструмента KZTO_T2 - ставка маржи 20 %, расчетная цена 900.

Подача заявки на покупку по KZTO (T+0) – цена 1050, количество 1, счет 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	-1050 / 0	0	0	0	450	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / -	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	1 / 0	0 / 0	0	0	0	0	0	0	0	0 / -	0 / -	0 / -	0 / -	0 / 0

Подача встречной заявки по счету 0002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	1050 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	-1 / 0	0	0	0	1	0	0	0	0 / -	0 / 0	0 / -	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	450	0 / 0	0 / 0	0	0	0	450	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	1050 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	1	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1	0	0	0	1 / -	1 / -	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	2050	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2050	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	1050 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	1	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1	0	0	0	0 / -	0 / 0	1 / -	0 / 0	1050 / 0

Исходное состояние счетов:

Счет покупателя: 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	0	0	0	3500	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0

Счет продавца: 002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача заявки на покупку по KZTO_T2 – цена 1000, количество 2, счет 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / -2000	360	0	0	3140	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 2	0 / 0	360	0	0	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача встречной заявки со счета 002 (по умолчанию маржа в виде бумаг)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 2000	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / -2	0	0	2	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца на день Т

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	0	0	-2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	0	2	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	0	2000	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	0	0	-2	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000

Состояние счетов на день T+1:

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	0	-2000	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	2	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0	Ожидает подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	0	2000	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	0	-2	0	0 / -2	0 /	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Ожидает подтверждения

Состояние счетов на день T+2 (утро)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	3140	-2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2000	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	2	0	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	0 / 0	Ожидает подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	0	0	0 / -2	0 /	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Ожидает подтверждения

Покупатель заключил сделку репо с неттингом (покупка бумаг) на 1 шт. с неким продавцом (не представлен в таблице). Цена открытия 900 тг., цена закрытия 899 тг.

Обеспечение по сделке открытия репо забрано в поле Блок (Т+2) в размере 900, маржа по сделке закрытия репо добавилась в поле МО: 360 + 180 = 540.

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТО П	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	540	0	900	2060	-2900	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 899	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	540	0	0	0	3	-1	0	0 / 2	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 899	Ожидает подтверждения
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Участником (в случае СПС) либо автоматически торговой системой (в случае не СПС) по позициям проставляется статус "Подтверждена".

По позиции KZTO осталось забрано маржевое обеспечение под сделку закрытия репо в размере 180. Маржевое обеспечение под ранее заключенную сделку с расчетами сегодня освободилось, вместо него забралось 100% обеспечения (+ 2000) в поле "Блок (Т+2)".

Состояние счетов на день Т+2: после подтверждения

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТО П	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	3500	0 / 0	0 / 0	180	0	2900	420	-2900	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	180	0	0	0	3	-1	0	0 / 2	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 899	Подтверждена
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. Т0/Т2	пл. уменьш. Т0/Т2	МО	МО(кредит)	Блок (Т+2)	Плановый остаток	Т0	Т1	Т2	Нетто / СумТО П	Куплено Т0/Т2	Продано Т0/Т2	Объем покупки Т0/Т2	Объем продажи Т0/Т2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1000	2000	899	0	0 / -	- / -	- / -	- / -	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Подтверждена

Состояние счетов на день T+2: после расчетов нетто-ведомости – обновилась поля Текущая, T0, T1, T2, Блок(T+2), Нетто/СумТОП.

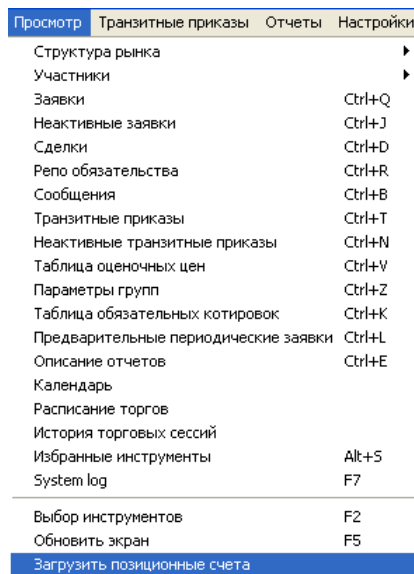
Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2.	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТО П	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	3500	600	0 / 0	0 / 0	180	0	0	420	0	899	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 2900	0 / 0	
KZTO_T2 \ KZTO	0	3	0 / 0	0 / 0	0	0	0	0	0	-1	0	0 / -1	0 / 3	0 / 1	0 / 2900	0 / 0	Подтверждена
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0 / 1	0 / 0	0 / 900	0 / 899	

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТО П	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2	Состояние
KZT (счет ЦД)	1000	3000	0 / 0	0 / 0	0	0	0	3000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	- / -	0 / 2000	
KZTO_T2 \ KZTO	2	0	0 / 0	0 / 0	0	0	0	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 2000	Подтверждена

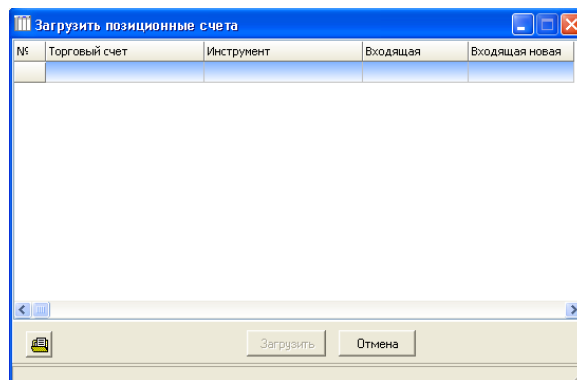
4.12. Загрузка денежных позиций с помощью XML-файла


Механизм загрузки позиций упрощает установку входящих денежных позиций на клиентских позиционных счетах брокера, согласно их остаткам на счетах в АО "Центральный депозитарий ценных бумаг", и ускоряет процесс их разнесения.

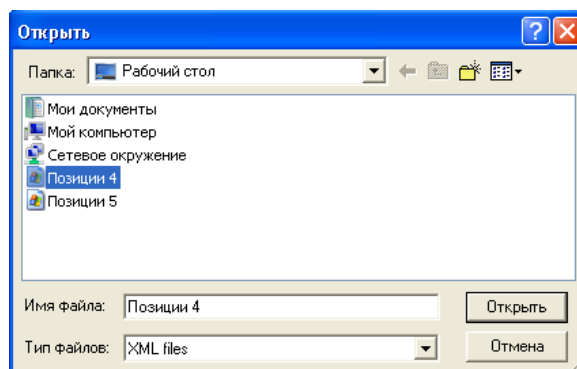
Открыть окно **"Загрузить позиционные счета"** можно через меню, путем выбора соответствующего пункта **"Просмотр"** – **"Загрузить позиционные счета"**.



Основная область окна **"Загрузить позиционные счета"** предназначена для предварительного просмотра загружаемых позиций.

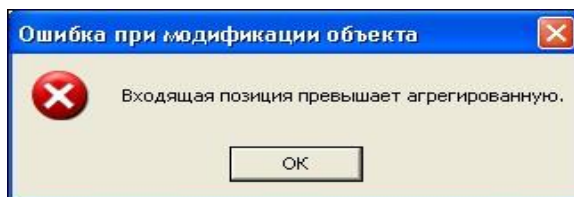


Для выбора XML-файла с позициями следует нажать кнопку , которая находится в нижней части окна "Загрузить позиционные счета", выбрать нужный файл и кликнуть на кнопку "Открыть".

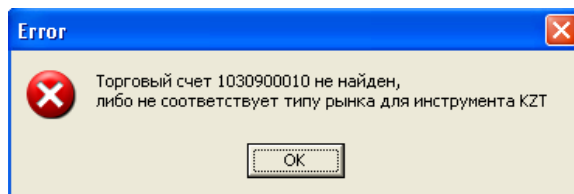


В терминале предусмотрены следующие системные сообщения для уведомления пользователя об ошибках, возникающих при загрузке XML-файла:

- в случае если агрегированная (общая) позиция на торговом счете Клиента превышает входящую:



- при несоответствии торгового счета загружаемого файла Клиента типу рынка:



При отсутствии ошибок информация из выбранного файла появится в основной области окна **"Загрузить позиционные счета"**.

№	Торговый счет	Инструмент	Входящая	Входящая новая
1	1026000000	KZT	0.00	0.00
2	1026000000	KZT (клиентск.)	10 000 000.00	10 000 000.00
3	1026000172	KZT	500 000.00	500 000.00
4	1026000407	KZT	1 000 000.00	1 000 000.00
5	1026000525	KZT	300 000.00	300 000.00
6	1026000546	KZT	1 000 000.00	1 000 000.00

В столбце **"Входящая"** отображается текущий размер денежной позиции, в столбце **"Входящая новая"** – значение из XML-файла.

Файл для загрузки в формате XML имеет следующие тэги:

- **<Root>** –тег верхнего уровня, в который заключается всё содержимое;
- **<DateTime>** – тег, содержащий текущую дату и время в формате DD.MM.YYYY hh:mm;
- **<Account>** – повторяющийся тег, является контейнером для тегов <Code> и <Instrument>;
- **<Code>** – тег, содержащий наименование торгового счета;
- **<Instrument>** – повторяющийся тег, является контейнером для тегов <Name> и <InPosition>;
- **<Name>** – тег, содержащий наименование инструмента;
- **<InPosition>** – тег, содержащий значение входящей для загрузки.

Пример XML-файла по загрузке денежных позиций на счета ЦД клиентов приведен ниже. При загрузке XML-ведомости на счета МСПД необходимо указать код для

позиции МСПД): "KZT (счет МСПД)": KZT_ISMT и для позиции "KZT (клиентский счет МСПД)": KZT_CLNTISMT.

```
- <Root>
  <DateTime>01.01.2011 00:00</DateTime>
  - <Account>
    <Code>1000300001</Code>
    - <Instrument>
      <Name>KZT</Name>
      <InPosition>15000</InPosition>
    </Instrument>
  </Account>
  - <Account>
    <Code>1000300002</Code>
    - <Instrument>
      <Name>KZT</Name>
      <InPosition>200000</InPosition>
    </Instrument>
  </Account>
  - <Account>
    <Code>1000300003</Code>
    - <Instrument>
      <Name>KZT</Name>
      <InPosition>1600000.0</InPosition>
    </Instrument>
  </Account>
</Root>
```

Для загрузки файлов на позиционные счета нажмите кнопку **"Загрузить"**. В результате успешной загрузки файлов в окне **"Позиционные счета"** будут видны загруженные позиции.



№ /	Торговый счет	Инструмент	Входящая	Текущая	Плановая на покупку	Плановая на продажу
1	1030900000	KZT	25 000 000.00	25 000 000.00	25 000 000.00	0.00
2	1030900000	KZT (клиентский счет)	10 250 000.00	2 920 000.71	2 920 000.71	0.00
3	1030900002	KZT	0.00	0.00	0.00	0.00
4	1030900003	KZT	520 000.16	520 000.16	520 000.16	0.00
5	1030900004	KZT	1 100 000.55	1 100 000.55	1 100 000.55	0.00
6	10307A0004	KZT	0.00	0.00	0.00	0.00
7	1030900005	KZT	300 000.00	300 000.00	300 000.00	0.00
8	1030900006	KZT	1 000 000.00	1 000 000.00	1 000 000.00	0.00
9	1030900009	KZT	0.00	0.00	0.00	0.00

4.13. Заявки

4.13.1. Активные заявки

В окне **"Заявки"** пользователь имеет возможность просмотреть перечень активных заявок (не удаленных и не удовлетворенных в ходе торгов), поданных от имени фирмы пользователя, и прямых заявок, поданных контрагентами с намерениями заключить прямую сделку с фирмой пользователя. Окно **"Заявки"** открывается:

- выбором в главном меню пункта **"Просмотр" – "Заявки"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+Q**).

В появившемся окне **"Заявки"** расположены все поданные на данный момент времени заявки;

- выбором пункта **"Финансовые инструменты" – "Заявки"** ("горячие" клавиши – **Alt+2**).

В появившемся окне **"Заявки"** расположены все поданные по выбранному инструменту на данный момент заявки.

№ /	Инструмент	Номер	B/S	Цена	Количество...	Объем (нач.)	Купон	Доходно...	Количество...	Объем (остаток)	Сост.	Зарегистрирована	Время истечения	Дата истече...
1	ABDID1	4.45...	B	75.0000	110 000	84 707.33	2.0067	56.7151	110 000	84 707.33	Лимитированная	04.04.2012 11:05...	---	---
2	ABDID1	4.45...	B	75.0100	110 000	84 718.33	2.0067	56.6883	110 000	84 718.33	Лимитированная	04.04.2012 11:05...	---	---
3	ABDID1	4.45...	B	75.0200	110 000	84 729.33	2.0067	56.6616	110 000	84 729.33	Лимитированная	04.04.2012 11:06...	---	---
4	ABDID1	4.45...	B	75.0300	110 000	84 740.33	2.0067	56.6349	110 000	84 740.33	Лимитированная	04.04.2012 11:07...	---	---
5	ABDID1	4.45...	B	75.5555	110 000	85 318.38	2.0067	55.2420	110 000	85 318.38	Лимитированная	04.04.2012 11:08...	---	---
6	ABDID1	4.45...	B	75.2200	110 000	84 949.33	2.0067	56.1288	110 000	84 949.33	Лимитированная	04.04.2012 11:08...	---	---

Каждая заявка имеет следующие атрибуты:

- Инструмент** – код инструмента в торговой системе Биржи
- Номер** – порядковый номер заявки
- B/S** – "B" – покупка, "S" – продажа
- Цена** – значение цены заявки, в тенге; по инструментам в иностранной валюте их стоимость пересчитывается системой в тенге автоматически, используя способ пересчета из таблицы «Валюты» (см. примечание по международным облигациям в п. 4.24).
- Количество (нач.)** – количество инструмента в заявке
- Купон** – сумма накопленного интереса, в процентах; рассчитывается системой автоматически по купонным ценным бумагам (не округляется, но отображается только 4 знака после запятой)
- Объем (нач.)** – сумма заявки в валюте расчета
- Доходность** – значение доходности заявки
- Количество (остаток)** – неудовлетворенное количество поданной заявки
 - состояние заявки:
 - 1) Лимитированная;
 - 2) Активная;
 - 3) Рыночная;
 - 4) Лимитированная (из двойной или рыночной);
 - 5) Удовлетворена частично;
 - 6) Ожидает подтверждения
- Сост.** –
- Пользователь** – идентификатор пользователя, подавшего заявку
- Зарегистрирована** – дата и время подачи заявки в торговую систему Биржи
- Торговый счет** – счет, по которому была подана заявка
- Время истечения** – время, до которого действует заявка
- Дата истечения** – дата, по которую действует заявка
- Обяз.ММ** – принадлежность котировки майкет-мейкеру
- Курс открытия** – цена открытия своп-операции (используется на рынке валютного свопа)
- Объем открытия** – объем открытия своп-заявки
- Курс закрытия** – цена закрытия своп-операции (используется на рынке валютного свопа)

Объем закрытия	–	объем закрытия своп-заявки
От кого	–	идентификатор фирмы, от которого получена прямая заявка
Кому	–	идентификатор фирмы, которой направлена прямая заявка
Дата расч.	–	дата расчетов в случае заключения прямой сделки
Расчеты	–	место проведения расчетов в случае заключения прямой сделки (Центральный депозитарий или регистратор)
Цена закр.	–	значение цены закрытия
Дата закр.	–	дата закрытия операции репо
Объект авторепо	–	код инструмента, выступающего в качестве объекта репо на рынке "автоматического" репо
К-во об.авторепо	–	количество инструмента, выступающего в качестве объекта репо на рынке "автоматического" репо
Объем закрытия (репо)	–	объем закрытия инструмента, выступающего в качестве объекта репо на рынке "автоматического" репо

Для удобства и быстроты восприятия информации тип заявки выделяется цветом:

Черным цветом – обычная заявка

Зеленым цветом – прямая заявка

Бордовым цветом – прямая заявка репо

Коричневым цветом – заявка, поданная на рынке "автоматического" репо

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной заявке делает доступными функции:

- **"Снять", "Удалить"** – предоставляют пользователю возможность прекратить действие поданной ранее заявки на величину неудовлетворенного остатка.

Для прямых заявок возможны следующие дополнительные функции:

- **"Удовлетворить"** – удовлетворение прямой заявки, поданной контрагентом. При ее удовлетворении открывается диалоговое окно, позволяющее трейдеру ввести параметры встречной заявки, аналогичные предложенным контрагентом (сделка заключается только в случае их соответствия);
- **"Отклонить"** – отказ от заключения сделки, по параметрам прямой заявки;
- **"Свойства"** – данная функция доступна для всех заявок и позволяет просмотреть параметры заявки.

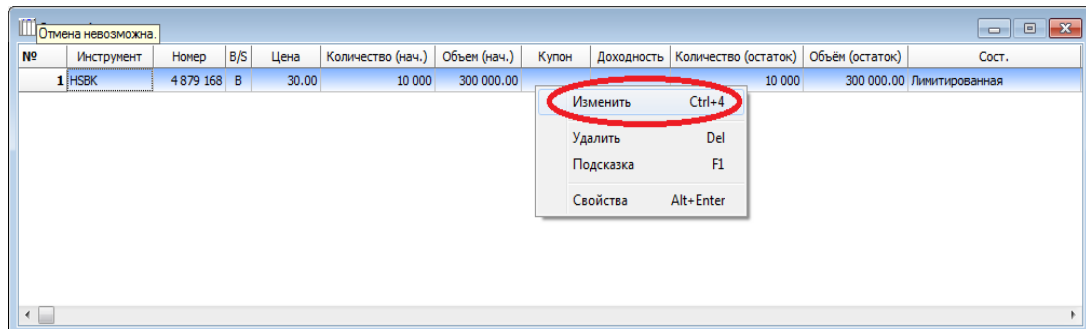
Для маркет-мейкерских заявок доступна функция:

- **"Изменить"** – предоставляет возможность маркет-мейкеру изменить цену выбранной заявки без ее удаления. При выполнении операций по изменению открывается окно "Параметры заявки" В данном окне необходимо изменить цену, после чего подтвердить внесенные изменения в открывшемся окне "Подтверждение изменений" путем нажатия кнопки "Изменить".

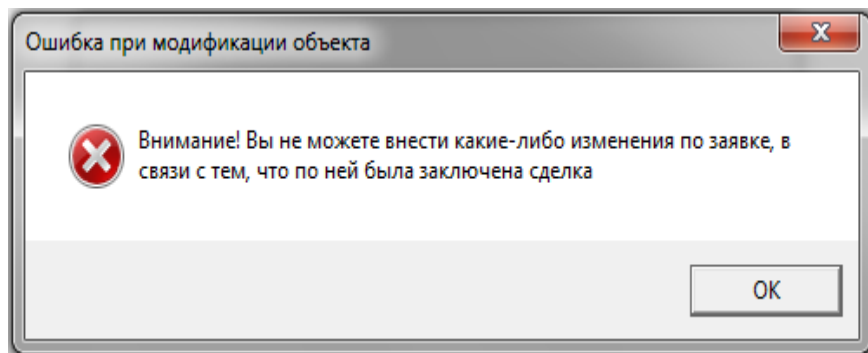
Внимание! В случае если в момент изменения заявки с признаком "Обязательная котировка ММ", в торговой системе данная заявка была частично удовлетворена, то при попытке изменения параметров заявки системой будет выдано сообщение "Внимание! Вы не можете внести какие-либо изменения по заявке, в связи с тем, что по ней была заключена сделка".

При изменении параметров заявки происходит создание новой заявки с измененными параметрами с одновременным удалением текущей заявки. Данная опция призвана сократить время на удаление текущей и формирование новой заявки.

Для изменения текущей заявки необходимо кликнуть правой кнопкой мыши по заявке и выбрать опцию **"Изменить"**, после чего внести изменения в значения полей цена и/или количество.



В случае если при изменении параметров выбранной заявки изменился статус такой заявки в результате ее частичного удовлетворения, то пользователь автоматически получает соответствующее уведомление о невозможности внесения изменений в данную заявку.



4.13.2. Неактивные заявки

В окне **"Неактивные заявки"** представлен перечень неактивных заявок (удаленных, удовлетворенных в ходе торгов). Просмотр неактивных заявок возможен только из окна **"Финансовые инструменты"** нажатием клавиш **Alt+4** на выбранном инструменте.

№ /	Номер	В/С	Цена	Количество (нач.)	Объем (нач.)	Количество (ост...)	Объем (остат...)	Сост.	Снята	Кем снята
2	4 458 458	В	77.0000	1 000 000	790 300.00	1 000 000	790 300.00	Удалена пользователе...	05.04.20...	КА999
3	4 458 459	В	75.5500	100 000	77 580.00	100 000	77 580.00	Удалена пользователе...	05.04.20...	КА999
4	4 458 460	В	78.0000	100 000	80 030.00	100 000	80 030.00	Удалена пользователе...	05.04.20...	КА999
5	4 458 461	В	75.0000	1 000 000	770 300.00	1 000 000	770 300.00	Удалена пользователе...	05.04.20...	КА999
6	4 458 462	С	74.5500	100 000	76 580.00	100 000	76 580.00	Удалена пользователе...	05.04.20...	КА999

В окне **"Неактивные заявки"**, кроме столбцов аналогичных столбцам окна **"Заявки"**, содержатся следующие дополнительные столбцы:

- Снята** – время и дата удаления заявки
- Кем снята** – идентификатор пользователя, удалившего заявку

4.13.3. Предварительные заявки

В случае если по какому-либо финансовому инструменту настройками торговой системы Биржи допускается подача предварительных заявок, в поле **"Сост."** (статус торгов) в окне **"Финансовые инструменты"** указывается значение **"P"** ("Preliminary").

№ /	Группа	Наименование	Полное наименование	Код	Со...	Забл...	Спрос	Предложе...	П.Спрос	П.Предл	Пред. ср. в...
417	Third_E	ZNGRp	Привилегированные именные акци...	KZ1P022...	T						9 870.50
418	First	A5Fip	Привилегированные акции АО "Аст...	KZ1P376...	C	X					22 728.00
419	First	BTAS	Простые акции АО "Банк ТуранАлен"	KZ1C349...	T		8 300.00				2 400.00
420	First	CCBN	Простые именные акции АО "Банк ...	KZ1C362...	P		360.00	483.90			449.65
421	First	H5BK	Простые акции АО "Народный сбер...	KZ1C338...	P		112.00	257.00			247.64

В период приема предварительных заявок их параметры (лучшие цены спроса и предложения, минимальная и максимальная цены и другие параметры предварительных заявок) не отображаются в окнах **"Финансовые инструменты"** и **"Котировки"**.

Внимание! В случае если в момент открытия торгов торговая система Биржи обнаружит совпадение или пересечение цен предварительных встречных заявок, торги автоматически переводятся в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов.

4.13.4. Двойные заявки

Подача двойной заявки возможна двумя способами:

- 1) из окна **"Финансовые инструменты"** путем нажатия кнопки на панели управления после выбора финансового инструмента;
- 2) из окна **"Таблица обязательных котировок"** путем двойного щелчка "мыши" ("горячие" клавиши – **Ctrl+Enter**) на выбранном финансовом инструменте.

При подаче двойной заявки появляется окно **"Параметры заявки"**, с помощью которого можно определить параметры двойной заявки.

The screenshot shows a window titled "Параметры заявки" (Bid Parameters) for instrument "AGKKB1". It features three radio buttons at the top: "Спрэд, YTM" (selected), "Спрэд, %" (unselected), and "Спрэд" (unselected). Below is a "2.00" input field. The main area is split into two columns: "Покупка" (Buy) and "Продажа" (Sell). Each column has a "Торговый счет" (Trading account) dropdown, a "Цена" (Price) field, a "Количество" (Quantity) field, and a "Доходность, %" (Yield, %) field. The "Покупка" section shows a price of 100.221, quantity of 2,200,000, and yield of 8%. The "Продажа" section shows a price of 104.8458, quantity of 2,200,000, and yield of 6.0000. There are also checkboxes for "Обязательная котировка MM" (checked), "Раздел счета депо" (Basic section selected), "Периодичность" (None selected), and "Устанавливать периодически заявки" (None selected). A "Время истечения" (Expiration time) field is at the bottom left, and "OK" and "Cancel" buttons are at the bottom.

Поля **"Покупка"** и **"Продажа"** в параметрах двойной заявки аналогичны соответствующим полям в параметрах обычной заявки, при этом в разделе **"Покупка"** двойной заявки указывается торговый счет, который будет использован при удовлетворении заявки на покупку, а в разделе **"Продажа"** – при удовлетворении заявки на продажу.

Как и в обычных заявках, в качестве параметров двойной заявки могут быть указаны либо цена финансового инструмента в установленной валюте торгов (поле **"Цена"**), либо доходность финансового инструмента, если по нему рассчитывается доходность (поле **"Доходность, %"").**

Внимание! При подаче двойной заявки цена продажи финансового инструмента должна быть выше цены его покупки; в противном случае пользователь получит системное сообщение торговой системы Биржи.

Следующие опции и поля могут использоваться при заполнении полей **"Покупка"** и **"Продажа"** в параметрах двойной заявки³:

- группа опций **"Периодичность"**;

Примечание При выборе опции **"Устанавливать ежедневно"** двойная заявка становится предварительной периодической двойной заявкой (пункт **"Предварительные периодические двойные заявки"**).

- группа опций **"Устанавливать периодически заявки"** (пункт **"Предварительные периодические двойные заявки"**);
- группа опций **"Спрэд"**;

³ В отличие от обычной заявки (только на продажу или покупку финансового инструмента) при заполнении двойной заявки опция **"Раздел счета депо"** не применяется, так как при удовлетворении двойной заявки всегда используется только основной раздел счета депо.

Примечание Спрэд может устанавливаться:

- в разнице доходности финансового инструмента исходя из цен его продажи и покупки (опция **"Спрэд, УТМ"**);
- в процентах между ценами продажи и покупки финансового инструмента (опция **"Спрэд, %"**);
- в абсолютном выражении разницы между ценами продажи и покупки финансового инструмента (опция **"Спрэд"**).

В случае установления какого-либо спреда цена продажи/покупки финансового инструмента будет автоматически рассчитываться торговой системой Биржи исходя из определенной пользователем цены покупки/продажи данного финансового инструмента и наоборот.

– поля **"Время истечения"** и **"Дата истечения"**.

Примечание Установленные пользователем время и дата истечения действия двойной заявки применяются как по отношению к покупке, так и к продаже финансового инструмента.

Дата истечения действия двойной заявки может быть установлена только в том случае, если данная двойная заявка является предварительной периодической двойной заявкой.

В зависимости от способа подачи двойной заявки:

- 1) из окна **"Финансовые инструменты"**:
 - спрэд автоматически не устанавливается;
 - поля **"Количество покупки"** и **"Количество продажи"** автоматически не заполняются;
- 2) из окна **"Таблица обязательных котировок"**:
 - спрэд устанавливается автоматически исходя из значения минимального спреда между обязательными котировками на продажу и покупку финансового инструмента;
 - поля **"Количество покупки"** и **"Количество продажи"** заполняются автоматически исходя из минимального количества обязательной котировки.

После ввода двойной заявки в окне **"Заявки"** появятся две заявки – на покупку и продажу финансового инструмента.

Аннулирование двойной заявки производится путем аннулирования заявок на покупку и продажу финансового инструмента, входящих в состав двойной заявки. Для того чтобы аннулировать заявку на покупку или продажу финансового инструмента, входящую в состав двойной заявки, необходимо в окне **"Заявки"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+Q**) подвести курсор к строке, соответствующей данной заявке, и нажать правую клавишу "мыши".

В результате появится всплывающее окно, содержащее функцию **"Снять"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+1**), с помощью которой данную заявку можно аннулировать.

4.13.5. Предварительные периодические двойные заявки

Двойная заявка становится предварительной периодической двойной заявкой при выборе опции **"Устанавливать ежедневно"** (пункт **"Предварительные заявки"**).

На основе принятой предварительной периодической двойной заявки торговая система Биржи каждый торговый день (в течение срока действия данной заявки) и только в момент открытия периода приема предварительных заявок, автоматически формирует две предварительные заявки – на покупку и продажу финансового инструмента.

Исключение Если предварительная периодическая двойная заявка первоначально вводится в ходе проведения торгов, то торговая система Биржи автоматически формирует на ее основе "обычную" двойную заявку, которая начинает действовать сразу после ее приема Биржей.

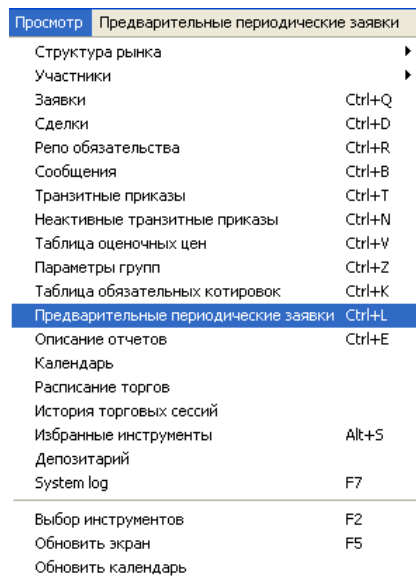
В случае если настройками торговой системы Биржи по какому-либо финансовому инструменту не допускается подача предварительных заявок, то, соответственно, торговая система Биржи не формирует предварительные заявки на основе введенной предварительной периодической двойной заявки.

Для предварительной периодической двойной заявки может быть установлен срок ее действия (путем указания необходимой даты в поле "**Дата истечения**" при определении параметров двойной заявки). В таком случае торговая система Биржи будет автоматически формировать по две предварительные заявки (на покупку и продажу финансового инструмента) в течение срока действия данной заявки до наступления даты (включительно), указанной в поле "**Дата истечения**".

В случае если срок действия предварительной периодической двойной заявки пользователем не установлен, то Торговая система будет автоматически формировать соответствующие предварительные заявки каждый торговый день, пока этот пользователь не аннулирует данную заявку.

Примечание При подаче предварительной периодической двойной заявки по облигациям рекомендуется использовать опцию "**в указанных доходностях**", поскольку в этом случае ежедневный расчет цены облигаций будет осуществляться торговой системой Биржи автоматически.

Введенная и принятая Биржей предварительная периодическая двойная заявка появляется в отдельном окне "**Предварительные периодические заявки**", которое можно открыть в меню "**Просмотр**" ("горячие" клавиши – **Ctrl+L**).



№	Инструмент	Номер	Предложение	Объем продажи	Доходно...	Продажа	Покупка	Доходно...	Объем покупки	Спрос	Пользователь	Зареги...
1	ВТА1b14	3 22...	2 550 000	2 177 227.56	13.0000	85.4113	79.6837	15.0000	2 031 118.96	2 550 000	127b07	12:42:С
2	ВТА5b4	3 26...	1 800 000	596 801.34	53.0000	29.3536	28.0491	55.0000	573 325.00	1 800 000	127b07	12:42:С
3	СНFM	3 21...	4 419	3 888 720.00		880.00	800.00		3 888 000.00	4 860	127b08	15:00:С
4	КА55b1	3 23...	2 060 000	1 901 910.59	17.0000	90.7926	88.6825	19.0000	1 858 367.30	2 060 000	127b07	12:42:С
5	LNAT	3 21...	416	3 889 600.00		9 350.00	8 500.00		3 893 000.00	458	127b08	15:00:С
6	MREKb4	3 21...	2 200 000	2 226 805.86	14.0000	95.7553	93.8074	15.0000	2 183 914.05	2 200 000	127b07	12:42:С
7	PRKRb2	3 21...	2 060 000	1 986 569.50	11.0000	91.7300	86.7693	13.0000	1 884 313.75	2 060 000	127b07	12:42:С
8	TEBN	3 21...	3 702	3 888 951.00		1 050.50	955.00		3 888 760.00	4 072	127b08	11:30:С

Для того чтобы редактировать ранее поданную предварительную периодическую двойную заявку, необходимо в окне **"Предварительные периодические заявки"** подвести курсор к строке, соответствующей данной заявке, и нажать правую клавишу "мыши". В результате появится всплывающее окно, в котором следует выбрать функцию **"Свойства"** ("горячие" клавиши – **Alt+Enter**), с помощью которой данную заявку можно отредактировать.

Редактирование предварительных периодических двойных заявок допускается в любой момент соединения с сервером торговой системы Биржи, в том числе и в случае, если торги закрыты.

Внимание! При редактировании предварительной периодической двойной заявки торговая система Биржи **не формирует** новые заявки на покупку и продажу финансового инструмента. Новые параметры предварительной периодической двойной заявки начинают использоваться для формирования предварительных заявок только в момент открытия очередного приема предварительных заявок.


Для того чтобы аннулировать предварительную периодическую двойную заявку, необходимо в окне **"Предварительные периодические заявки"** подвести курсор к строке, соответствующей данной заявке, и нажать правую клавишу "мыши". В результате появится всплывающее окно, содержащее функцию **"Снять"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+1**), с помощью которой данную заявку можно аннулировать.

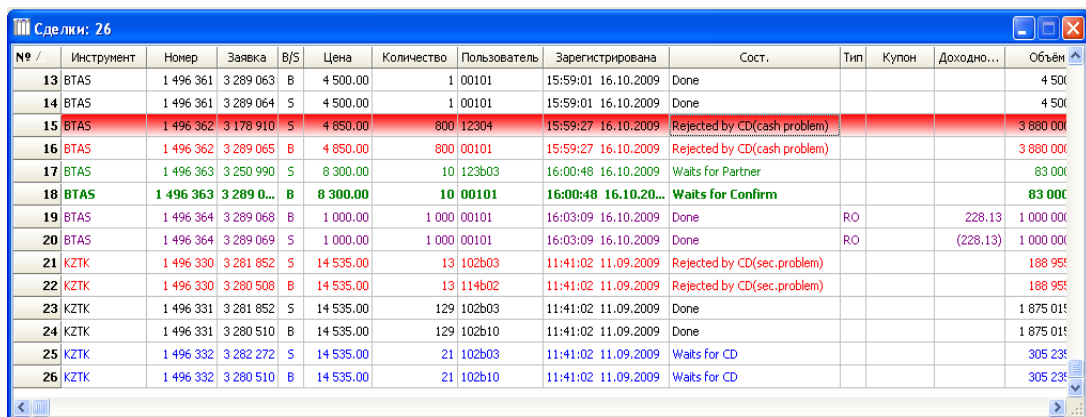
4.14. Сделки

В окне **"Сделки"** пользователь имеет возможность просмотреть перечень сделок, заключенных от имени его фирмы.

Примечание Пользователь, определенный в торговой системе Биржи как пользователь системы подтверждения, не заключает сделки самостоятельно, он только подтверждает сделки, заключенные по торговым счетам его организации другими участниками. Пользователь системы подтверждения относится к организации (а не к фирме как трейдер).
Без подтверждения пользователя системы подтверждения сделка не может быть отправлена на расчеты в Центральный депозитарий.

Окно **"Сделки"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр" – "Сделки"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+D**;
- нажав кнопку  на панели управления.



№ /	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Пользователь	Зарегистрирована	Сост.	Тип	Купон	Доходно...	Объем
13	BTAS	1 496 361	3 289 063	B	4 500.00	1	00101	15:59:01 16.10.2009	Done				4 500
14	BTAS	1 496 361	3 289 064	S	4 500.00	1	00101	15:59:01 16.10.2009	Done				4 500
15	BTAS	1 496 362	3 178 910	S	4 850.00	800	12304	15:59:27 16.10.2009	Rejected by CD(cash problem)				3 880 000
16	BTAS	1 496 362	3 289 065	B	4 850.00	800	00101	15:59:27 16.10.2009	Rejected by CD(cash problem)				3 880 000
17	BTAS	1 496 363	3 250 990	S	8 300.00	10	123b03	16:00:48 16.10.2009	Waits for Partner				83 000
18	BTAS	1 496 363	3 289 0...	B	8 300.00	10	00101	16:00:48 16.10.20...	Waits for Confirm				83 000
19	BTAS	1 496 364	3 289 068	B	1 000.00	1 000	00101	16:03:09 16.10.2009	Done	RO		228.13	1 000 000
20	BTAS	1 496 364	3 289 069	S	1 000.00	1 000	00101	16:03:09 16.10.2009	Done	RO		(228.13)	1 000 000
21	KZTK	1 496 330	3 281 852	S	14 535.00	13	102b03	11:41:02 11.09.2009	Rejected by CD(sec.problem)				188 950
22	KZTK	1 496 330	3 280 508	B	14 535.00	13	114b02	11:41:02 11.09.2009	Rejected by CD(sec.problem)				188 950
23	KZTK	1 496 331	3 281 852	S	14 535.00	129	102b03	11:41:02 11.09.2009	Done				1 875 010
24	KZTK	1 496 331	3 280 510	B	14 535.00	129	102b10	11:41:02 11.09.2009	Done				1 875 010
25	KZTK	1 496 332	3 282 272	S	14 535.00	21	102b03	11:41:02 11.09.2009	Waits for CD				305 230
26	KZTK	1 496 332	3 280 510	B	14 535.00	21	102b10	11:41:02 11.09.2009	Waits for CD				305 230

Каждая сделка имеет следующие атрибуты:

Инструмент	– код инструмента в торговой системе Биржи
Номер	– порядковый номер сделки
Заявка	– порядковый номер заявки, на основе которой была заключена сделка
B/S	– "B" – покупка, "S" – продажа
Цена	– цена сделки
Количество	– количество инструмента в сделке
Пользователь	– идентификатор пользователя, заключившего сделку
Сост.	– состояние расчетов по сделке: <p>"Done" – расчеты по сделке завершены или осуществляются по окончании торгов, после проведения клиринговой сессии</p> <p>"Waits for CD" – ожидает расчетов в Центральном депозитории</p> <p>"Waits for Clearing" – статус, в котором формируются сделки с расчетами T+2, в ожидании расчетов</p> <p>"Waits for Confirm" – ожидает подтверждения пользователя системы подтверждения</p> <p>"Waits for Partner" – ожидает подтверждения пользователя системы подтверждения со стороны контрагента</p> <p>"Rejected by CD" – сделка отклонена Центральным депозитарием</p> <p>"Rejected by CD (sec. problem)" – сделка отклонена Центральным депозитарием по причине отсутствия ценных бумаг на субсчете продавца</p> <p>"Rejected by CD (cash. problem)" – сделка отклонена Центральным депозитарием по причине отсутствия денег на субсчете покупателя</p> <p>"Rejected by CD" – сделка отклонена Центральным депозитарием</p> <p>"Rejected by Investor" – сделка отклонена пользователем системы подтверждения</p> <p>"Rejected by Partner" – сделка отклонена пользователем системы подтверждения со стороны контрагента</p> <p>"Wait for Cancellation" – при переводе сделки в данный статус, контрагент может расторгнуть сделку, либо сообщить о готовности исполнить сделку</p> <p>"Waits for agreement" – ожидает согласия продавца денег на проведение повторных расчетов после замены объекта "автоматического" репо со стороны покупателя денег</p> <p>"Waits for double agreement (cash. problem)" – ожидает согласия контрагента на проведение повторных расчетов по сделке в связи с отсутствием денег на субсчете</p> <p>"Waits for double agreement (sec. problem)" – ожидает согласия контрагента на проведение повторных расчетов по сделке в связи с отсутствием ценных бумаг на субсчете</p> <p>"Waits for change note" – ожидает замены объекта</p>

"автоматического" репо со стороны покупателя денег

"No agreement (sec.problem)", "No agreement (sec.problem)" – отказ от проведения повторных расчетов

"No agreement (chg repo)" – отказ продавца денег от проведения повторных расчетов после замены объекта "автоматического" репо со стороны покупателя денег

"Cancelled" – сделка расторгнута контрагентом

"Waits for Buyer" – ожидает оплаты покупателя векселя

"Paid by Buyer" – произведена оплата со стороны покупателя векселя

"Unpaid" – не произведена оплата со стороны покупателя векселя

"Note Delivered" – вексель поставлен покупателю

"Undelivered" – вексель не поставлен покупателю

Торговый счет	– счет, по которому была заключена сделка
Зарегистрирована	– дата и время заключения сделки
Тип	– тип сделки репо: "RO" – репо открытие, "RC" – репо закрытие
Купон	– сумма накопленного интереса в процентах; рассчитывается торговой системой Биржи автоматически по купонным ценным бумагам (не округляется, но отображается только 4 знака после запятой)
Доходность	– доходность; рассчитывается торговой системой Биржи автоматически по долговым ценным бумагам или операциям репо
Объем	– сумма сделки в установленной валюте торгов
Дата расч.	– дата проведения расчетов сделки
Курс открытия	– цена открытия своп-операции (используется на рынке валютного свопа)
Объем открытия	– объем открытия сделки по своп-операции
Курс закрытия	– цена закрытия своп-операции (используется на рынке валютного свопа)
Объем закрытия	– объем закрытия сделки по своп-операции
Цена закр.	– значение цены закрытия
Дата закр.	– дата проведения обратной сделки для операции репо
Контрагент	– идентификатор пользователя, с которым заключена прямая сделка
Фирма контрагента	– код фирмы, с которой заключена прямая сделка
Расчеты	– место проведения расчетов по прямой сделке (Центральный депозитарий или регистратор)
Рассчитана	– дата расчетов сделки
По свопу	– проставляется знак "+" по "ногам" свопа
Обяз.ММ	– проставляется знак "+" в случае совершения сделки по заявке ММ

Объект авторепо	–	код инструмента, выступающего в качестве объекта репо на рынке "автоматического" репо
К-во об. авторепо	–	количество инструмента, выступающего в качестве объекта репо на рынке "автоматического" репо
Цена Авторепо	об. –	цена объекта "автоматического" репо; используется в выбранной сделке "автоматического" репо
Объем закрытия (репо)	–	объем сделки закрытия "автоматического" репо

Для удобства и быстроты восприятия информации тип сделки и ее состояние выделяются цветом:

- **"Done"** – расчеты по сделке завершены или осуществляются по окончании торгов:

Черным цветом – обычная сделка

Бордовым цветом – "прямое" репо

Коричневым цветом – сделка на рынке "автоматического" репо

- **"Waits for CD"** – ожидает расчетов Центрального депозитария:

Синим цветом – обычная сделка

Темно-синим цветом – "прямое" репо, сделка на рынке "автоматического" репо

- **"Waits for Confirm"** – ожидание подтверждения пользователя системы подтверждения:

Зеленым цветом – обычная сделка

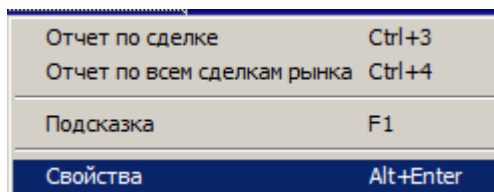
Бирюзовым цветом – "прямое" репо, сделка на рынке "автоматического" репо

- **"Rejected ..."** – расчеты по сделке не прошли:

Красным цветом – обычная сделка

Розовым цветом – "прямое" репо, сделка на рынке "автоматического" репо

При нажатии правой клавиши "мыши" на выбранной сделке открывается контекстное меню:



В меню доступны следующие основные функции:

- **"Отчет по всем сделкам", "Отчет по сделке"** – позволяют просмотреть в электронном виде специальный отчет по отдельной сделке или сделкам, относящимся к сектору рынка выбранной сделки, а также распечатать данный отчет на локальном принтере пользователя. Информация в отчете подписывается электронной подписью Биржи. Для получения полной информации по данной теме смотрите главу **"Электронный документооборот"**;

- **"Свойства"** – данная функция доступна для всех сделок и позволяет просмотреть параметры поданных заявок на покупку и на продажу.

По инструментам со схемой расчетов T+2 (в том числе по операциям репо с неттингом) в окне параметров сделки, в блоке "Комиссия брокера", доступна функция ввода брокерской комиссии:

Параметры сделки

KZTK_T2 Торговый счет: 10307A0089

Направл.: Пок. Прод. Тип заявки: Лимитированная Рыночная

Цена: 10 000.00 Количество: 0

Объем: 40 000.00

Обязательная котировка MM Автомат

Комиссия брокера в % от суммы сделки: в тг.:

Тип маржирования: Бумаги Деньги

Изменить Отмена Справка

Параметры сделки

RN_KZTK Торговый счет: 10307A0097

Валюты: Тенге Валюта торгов

Объект авторепо:

Параметры открытия:

Направл.: Пок. Прод. Ставка репо:

Цена откр.: Количество: Объем открытия:

Рыночная цена:

Параметры закрытия:

Направл.: Пок. Прод. Срок (дней): Дата закр. (D/M/YYYY):


Цена закр.: Ставка репо(факт.): Объем закр.:

Комиссия брокера в % от суммы сделки: в тг.:

Изменить Отмена Справка

Комиссия брокера может устанавливаться в одной из двух величин:

- в процентном соотношении к сумме сделки в поле "в % от суммы сделки", при этом значение поля "в тг.:" будет рассчитано автоматически;
- в денежном выражении в поле "в тг.:", при этом значение поля "в % от суммы сделки" будет рассчитано автоматически.

Значение комиссии может вводиться или корректироваться в соответствующем поле как вручную, так и при помощи кнопки уменьшения и увеличения .

Поля блока "Комиссия брокера" становятся недоступны для редактирования после наступления следующих событий:

- для сделок с использованием кастодиального счета – после того, как сделка подтверждена кастодианом (сделка перешла в состояние "Wait for Clearing");
- для сделок без использования кастодиального счета – после того, как позиция, образованная данной сделкой подтверждена (сделка перешла в состояние "Wait for CD").

4.15. Котировки

В окне **"Котировки"** представлена очередь неудовлетворенных (активных) заявок, ранжированных и сведенных по ценам. Каждая строка окна соответствует цене данной заявки и суммарному количеству инструмента, выставленного на покупку или на продажу по данной цене. Окно **"Котировки"** можно открыть следующими способами:

- в окне **"Финансовые инструменты"** – **"Котировки"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+Enter** или **Alt+3**;



№	Продажа	Цена	Покупка	Ист. объем
1	1 000	127.0000...		1 000
2	11 000 000	126.3359...		11 000 000
3	1 000	125.0000...		1 000
4		118.0000...	11 000 000	11 000 000
5		117.0000...	1 000	1 000

Цены в окне **"Котировки"** ранжированы по убыванию. Цены минимальной продажи и максимальной покупки выделены красным цветом. По инструментам с расчетом доходности подсчитывается доходность.

Каждая котировка имеет следующие атрибуты:

- Продажа** – суммарное количество инструмента, выставленное на продажу по одной цене
- Цена** – заявленная цена
- Покупка** – суммарное количество инструмента, выставленное на покупку по одной цене
- Ист.объем** – остаток количества инструмента, заявленного трейдером по данной цене

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной котировке открывает доступ к функциям:

- **"Удовлетворить"**, **"Создать"** – подать встречную заявку по цене котировки; параметры встречной заявки по умолчанию идентичны выбранной котировке. Во избежание технических ошибок в меню **"Настройки"** имеется возможность

отключить флаг **"Автоподбор лучших цен"**. В этом случае, а также при выборе функции **"Создать"** подбор параметров встречной заявки не производится;

- **"Снять", "Удалить"** – предоставляют возможность трейдеру снять/удалить собственную котировку, в случае если по выбранной цене имеются поданные им заявки.

4.16. Прямые котировки

В окне **"Прямые котировки"** представлены индикативные котировки участников торгов по выбранному финансовому инструменту. Данное окно можно открыть нажатием клавиш **Alt+5** из окна **"Финансовые инструменты"**.

Каждая строка окна соответствует фирме, подавшей индикативную котировку, и отражает ее намерение заключить сделку по указанным ценам и объемам купли/продажи.

Кроме этого, в окне имеются две первых специальных строки, в которых подсчитываются средние котировки и приводятся значения лучших котировок по ценам покупки и продажи.

№	Контрагент	Спрос	Предложение	Покупка	Продажа	Прим.	Зарегистрирована	Активная
1	Avg/Total	5.00	7.50	1 300 000 000	1 300 000 000	-	-	-
2	The Best	10.00	4.00	100 000 000	100 000 000	-	-	-
3	EURAS	3.00	7.00	100 000 000	100 000 000		10:00:55 13.05.2009	+
4	KKB_	7.00	8.00	1 000 000 000	1 000 000 000		10:01:09 13.05.2009	+
5	MERCH	3.00	4.00	100 000 000	100 000 000		10:01:24 13.05.2009	+
6	TURAL	10.00	20.00	100 000 000	100 000 000		10:01:48 13.05.2009	+

Каждая прямая котировка имеет следующие атрибуты:

- Контрагент** – код фирмы, от имени которой была объявлена индикативная котировка
- Спрос** – индикативная котировка на покупку
- Предложение** – индикативная котировка на продажу
- Покупка** – количество инструмента, по индикативной котировке на покупку
- Продажа** – количество инструмента, по индикативной котировке на продажу
- Прим.** – примечание объявившего котировку
- Зарегистрирована** – дата и время подачи прямой котировки
- Активная** – статус прямой котировки:
 - "+" – активная котировка
 - "-" – неактивная котировка

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной индикативной котировке делает доступными функции:

- **"Заявка на покупку", "Заявка на продажу"** – возможность подачи встречной прямой заявки на покупку или продажу контрагенту. При этом параметры прямой заявки соответствуют параметрам выбранной индикативной котировки. Подача индикативной котировки не накладывает на контрагента обязательства удовлетворить поданные по ней прямые заявки;
- **"Свойства" (Alt+Enter)** – предоставляет возможность подачи и редактирования собственных индикативных котировок. Подачу индикативной котировки можно

также осуществить, выбрав пункт **"Прямые котировки"** в меню **"Просмотр"** или нажатием комбинации клавиш **Ctrl+W**.

Внимание! Если прямая котировка была изменена после закрытия торгов по данному инструменту, то эта котировка примет статус неактивной. Данный статус указывает на необходимость повторно выставить ее после возобновления торгов.

Сохранение параметров объявленных индикативных котировок производится пользователем с помощью опции **"Сохранение"**, которая включена **по умолчанию**.

Примечание Необходимо различать:

- индикативные котировки, объявленные при проведении торгов;
- индикативные котировки, параметры которых были сохранены с помощью опции **"Сохранение"**, но которые фактически не были объявлены при проведении торгов.

Соответственно, для того чтобы индикативная котировка с сохраненными параметрами была доступна для просмотра всем пользователям и могла быть использована для заключения сделки, она должна быть объявлена при проведении торгов.

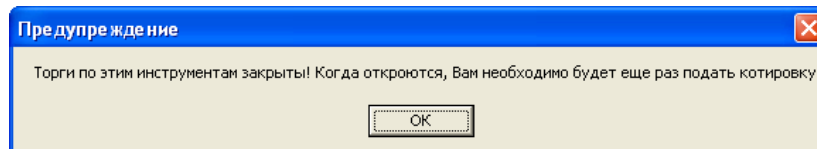
Значения лучших цен всех объявленных индикативных котировок отображаются в полях **"П.Спрос"** и **"П.Предложение"** окна **"Финансовые инструменты"**.

Параметры всех объявленных индикативных котировок по какому-либо финансовому инструменту с указанием торговых кодов объявивших их членов Биржи, а также средние и лучшие значения таких котировок доступны в окне **"Прямые котировки"** по данному инструменту.

С помощью окна **"Прямые котировки"** пользователь может также редактировать ранее сохраненные параметры его индикативных котировок.

Примечание Если у члена Биржи имеется несколько пользователей, имеющих право объявлять индикативные котировки в одном и том же секторе рынка, то один из таких пользователей имеет право редактировать индикативные котировки, ранее объявленные другими такими пользователями.

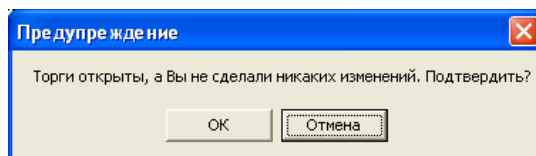
Редактирование ранее сохраненных параметров индикативных котировок допускается в любой момент соединения с сервером торговой системы Биржи, в том числе и в том случае, если торги закрыты. Однако в таком случае пользователь получит следующее сообщение:



Внимание! В случае если пользователь какого-либо члена Биржи отредактировал ранее сохраненные параметры индикативной котировки, но не объявил эту котировку при проведении торгов, она будет доступна для обозрения только пользователям данного члена Биржи.

Соответственно, эта котировка не будет учитываться при расчете средних и лучших значений всех объявленных индикативных котировок.

В случае если при проведении торгов пользователь объявляет индикативную котировку с ранее сохраненными параметрами без их предварительного редактирования, он получит следующее сообщение:



При выборе варианта **"ОК"** пользователь объявляет индикативную котировку без редактирования ее ранее сохраненных параметров.

При выборе варианта **"Отмена"** пользователь возвращается к редактированию ранее сохраненных параметров индикативной котировки.

4.17. Репо-обязательства

В окне **"Репо-обязательства"** представлен перечень репо-обязательств организации пользователя по исполнению сделок закрытия на текущую и последующие даты, отсортированный по дате закрытия. Окно можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр" – "Репо-обязательства"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+R**.

Объект репо-обязательства возникает при заключении сделки открытия и находится в окне **"Репо-обязательства"** до проведения обратной сделки. Для исполнения репо-обязательства каждая из сторон сделки должна подтвердить проведение сделки закрытия. Пользователи системы подтверждения могут осуществлять контроль над сделками закрытия репо.

В открытом окне **"Репо-обязательства"** отражаются параметры сделок закрытия репо, подлежащих исполнению и отсортированных по датам закрытия репо.

Сделки репо отображаются различными цветами и шрифтами:

- **коричневым** цветом отображаются сделки, относящиеся к операциям репо, которые осуществляются "автоматическим" способом;
- черным цветом отображаются сделки закрытия, относящиеся к операциям репо, которые осуществляются "прямым" способом;
- **полужирным** шрифтом отображаются сделки закрытия, подлежащие исполнению в текущий день.

№ /	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Дата откр.	Сделка откр.
20	14.09.2009	SKK2b1	955.4658	2 000 000 000	NBRK_	ALB_	950.0000	15:30:09 17.08.2009	1 493 352
21	14.09.2009	SKK2b1	955.4658	2 000 000 000	NBRK_	ALB_	950.0000	15:30:31 17.08.2009	1 493 353
22	24.09.2009	R_ATFBe4_007	1 100.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	1 100.0000	15:16:01 17.09.2009	1 496 336
23	25.09.2009	REPO_KZT_002	1 600.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	1 600.0000	12:22:05 24.09.2009	1 496 351
24	25.09.2009	REPO_KZT_002	3 000.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	3 000.0000	12:21:46 24.09.2009	1 496 350
25	25.09.2009	REPO_KZT_002	1 600.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	1 600.0000	12:21:15 24.09.2009	1 496 349
26	25.09.2009	REPO_KZT_002	1 600.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	1 600.0000	12:21:15 24.09.2009	1 496 348
27	25.09.2009	REPO_KZT_002	1 600.0000	1 000	NBRK_	NBRK_	1 600.0000	12:19:20 24.09.2009	1 496 347
28	01.10.2009	R_ATFBe4_014	400.0000	100	NBRK_	NBRK_	400.0000	15:27:42 17.09.2009	1 496 337
29	01.11.2009	BTAS	1 100.00	1 000	NBRK_	NBRK_	1 000.00	16:03:09 16.10.2009	1 496 364
30	01.11.2009	BTAS	1 200.00	1	NBRK_	NBRK_	1 000.00	10:57:02 17.09.2009	1 496 335

Каждое репо-обязательство имеет следующие атрибуты:

- Дата закр.** – дата сделки закрытия
- К-во дней в репо** – количество дней до закрытия сделки репо
- Инструмент** – код инструмента в торговой системе Биржи
- Цена закр.** – цена сделки закрытия репо

Количество	– количество объекта репо
Счет списания	– торговый счет, с которого после закрытия операции репо будет списан объект репо
Счет зачисления	– торговый счет, на который после закрытия операции репо будет зачислен объект репо
Продавец	– код фирмы продавца по сделке закрытия репо
Покупатель	– код фирмы покупателя по сделке закрытия репо
Цена откр.	– цена по сделке открытия репо
Дата откр.	– дата открытия репо
Сделка откр.	– порядковый номер сделки открытия
Сделка закр.	– порядковый номер сделки закрытия (если репо-обязательство закрыто)
Продал	– ID пользователя, подтвердившего сделку закрытия от имени продавца
Сост.прод.	– состояние, отражающее подтверждение сделки закрытия продавцом
Продано	– время и дата подтверждения сделки закрытия продавцом
Купил	– ID пользователя, подтвердившего сделку закрытия от имени покупателя
Сост.пок.	– состояние, отражающее подтверждение сделки закрытия покупателем
Куплено	– время и дата подтверждения сделки закрытия покупателем
Объект авторепо	– код объекта репо на рынке "автоматического" репо
К-во об.авторепо	– количество объекта репо на рынке "автоматического" репо
Цена откр.об.авторепо	– цена объекта репо на рынке "автоматического" репо по сделке открытия
Цена закр.об.авторепо	– цена объекта репо на рынке "автоматического" репо по сделке закрытия
Объем закрытия (репо)	– сумма сделки закрытия на рынке "автоматического" репо
Текущая рыночная цена	– цена ценных бумаг, принимаемая для расчетов, определяемая в соответствии с Методикой оценки ценных бумаг ⁴
Объем открытия (репо)	– объем открытия операции репо
Доп.ур.риска	– выраженная в процентах величина допустимого отклонения рыночной цены предмета операции репо, согласованная участниками при осуществлении данной операции репо, по достижении которой наступает случай нижней ⁵ или верхней ⁶ переоценки

⁴ "Методика оценки ценных бумаг" – Методика оценки ценных бумаг, утвержденная решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" от 19 февраля 2003 года № 22/0;

⁵ "Нижняя переоценка" – событие, в результате которого покупатель репо в случае уменьшения рыночной цены предмета операции репо ниже установленного уровня имеет право произвести переоценку обязательств по сделке закрытия репо. Нижняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения продавцом репо своих обязательств по сделке закрытия;

⁶ "Верхняя переоценка" – событие, в результате которого продавец репо в случае увеличения рыночной цены предмета операции репо выше установленного уровня имеет право произвести

Ставка репо(факт.)	– параметр операции репо, высчитываемый торговой системой автоматически на основе ставки репо ⁷ устанавливаемой участниками операции репо
Сост.	– статус репо-обязательства
Об-во покупателя по КП	– обязательство покупателя перед продавцом по оплате компенсационного платежа ⁸
Об-во продавца по КП	– обязательство продавца перед покупателем по оплате компенсационного платежа
Оплаченный КП покупателя	– компенсационные платежи, оплаченные покупателем
Оплаченный КП продавца	– компенсационные платежи, оплаченные продавцом

Нажатием правой клавиши "мыши" на выбранном репо-обязательстве открывает доступ к функциям:

- **"Компенсационные платежи"** (Alt+1) – переход в соответствующее окно, подробная информация предоставлена в пункте **"Компенсационные платежи"**.
- **"Выполнить покупку"**, **"Выполнить продажу"**, **"Отклонить покупку"**, **"Отклонить продажу"** – выбор соответствующей функции означает согласие или отказ покупателя/продавца осуществить сделку закрытия. При выборе функций в соответствующих полях **"Сост. Покупателя"**, **"Сост. Продавца"** появляется:
 - **"+"** – при подтверждении сделки закрытия;
 - **"–"** – в случае отказа от заключения сделки закрытия;
 - **" "** – сторона операции репо не приняла решение по исполнению сделки закрытия, что равнозначно отказу от заключения сделки закрытия репо.
- **"Свойства"** – опция, позволяющая оператору в ручном режиме изменять параметры сделки закрытия репо.

4.17.1. Компенсационные платежи

В окне **"Компенсационные платежи"** представлена вся история по репо-обязательствам. Окно можно открыть нажатием правой клавиши "мыши" ("горячая" клавиши – Alt+1) по выбранной записи в окне **"Репо обязательства"**.

№ /	Дата	Переоценка (%)	Текущая рыночная цена	Сост.	Об-во покупателя по КП	Об-во продавца по КП
1	12.04.2010	1.0526	960.0000	Paid	0.00	0.00
2	12.04.2010	1.0417	970.0000	Waits for User	10 000.00	0.00

переоценку обязательств по сделке закрытия репо. Верхняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения покупателем репо своих обязательств по сделке закрытия;

⁷ "Ставка репо" – параметр операции репо, устанавливаемый участниками операции репо, и используемый для расчета цены открытия и закрытия, суммы сделки закрытия при ее досрочном исполнении, и для начисления процентов в случае возникновения компенсационных платежей.

⁸ "Компенсационный платеж" – сумма денег, перечисляемая продавцом репо или покупателем репо при проведении нижней или верхней переоценки.

Отдельные столбцы окна означают следующее:

Дата	–	дата возникновения переоценки
Переоценка (%)	–	величина переоценки
Текущая рыночная цена	–	рыночная цена ⁹ на момент переоценки
		состояние компенсационного платежа:
		"Waits for User" – ожидание действий пользователя
		"Waits for Partner" – ожидание действий контрагента по подтверждению/отказу оплаты компенсационного платежа
		"Waits for Confirm" – ожидание действий пользователя системы подтверждения
		"Waits for CD" - компенсационный платеж находится на расчетах в Центральном депозитарии
Сост.	–	"Paid" – компенсационный платеж оплачен "Not need" - компенсационный платеж не был затребован "Rejected by User" – отказ контрагента от оплаты компенсационного платежа "Rejected by Confirm" – отказ пользователя системы подтверждения от оплаты компенсационного платежа "Rejected by CD (cash problem)" – отказ Центральным депозитарием произвести оплату по компенсационному платежу по причине отсутствия денег на субсчете пользователя
Об-во покупателя по КП	–	обязательство покупателя перед продавцом по оплате компенсационного платежа
Об-во продавца по КП	–	обязательство продавца перед покупателем по оплате компенсационного платежа
Оплаченный КП покупателя	–	компенсационные платежи, оплаченные покупателем
Оплаченный КП продавца	–	компенсационные платежи, оплаченные продавцом
% по КП покупателя	–	проценты, начисленные по компенсационному платежу, покупателю
% по КП продавца	–	проценты, начисленные по компенсационному платежу, продавцу

4.18. Транзитные приказы

Данный объект предназначен для передачи приказов от клиента брокеру. В качестве клиента брокера может выступать, например, член Биржи, не имеющий прав на торговлю определенными инструментами и передающий собственные приказы, или пользователь, обслуживающийся у брокера и подключенный к торговой системе Биржи. Участник, выступающий в роли брокера, получив приказ, на его основе подает заявку в торговую систему Биржи по счету клиента или иному счету.

⁹ "Рыночная цена" – цена ценных бумаг, принимаемая для расчетов по настоящему соглашению, определяемая в соответствии с Методикой оценки ценных бумаг;

В окне **"Транзитные приказы"** брокер и клиент брокера могут просматривать поданные клиентом брокера приказы. Окно **"Транзитные приказы"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр" – "Транзитные приказы"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+T**;

№ /	Номер	Заявка	Инструмент	Сост.	Пользователь	В/Б	Цена	Количество	Клиентский счет	Объем	Остаток	Зарегистрирована	От ко
30	62 567	3 464 458	MREKb5	Deal	CE003	S	112.3000	2 340 000	1027700185	2 793 180.00	0	11:34:48 21.01....	CE003
31	63 038	3 472 560	MREKb5	Deleted balance by Investor	CE003	S	113.0000	2 340 000	1027700185	2 816 840.00	1 490 000	11:38:30 28.01....	CE003
32	63 286	3 477 310	HSBkb13	Deal	CE003	S	115.0000	2 400 000	1027700185	2 834 533.33	0	11:34:54 02.02....	CE003
33	63 690	3 482 902	BTASe3	Active	CE003	S	80.0000	1 200 000	1027700185	144 312 711...	1 200 000	13:07:45 05.02....	CE003
34	63 824	3 486 115	BTASb4	Deleted by Operator	CE003	S	66.6666	9 000 000	1027700185	6 117 994.00	9 000 000	11:55:15 09.02....	CE003
35	64 502	3 499 252	DNTLb1	Deleted by Investor	TA052	B	55.0000	100 000	1026002197	59 416.67	100 000	15:26:00 19.02....	TA052
36	64 822	3 506 506	CCBN	Deleted by Investor	SR007	B	700.0100	1 000	1030800059	700 010.00	1 000	16:41:04 25.02....	SR007
37	65 339	3 518 659	MREKb5	Deleted by Investor	CE003	S	114.0000	2 340 000	1027700185	2 696 720.00	2 340 000	12:04:20 10.03....	CE003
38	65 442	3 520 401	HSBkb13	Deleted by Investor	CE003	S	117.0000	2 400 000	1027700185	2 916 333.33	2 400 000	11:37:05 11.03....	CE003
39	65 460	3 520 563	CS8nb5	Deleted by Investor	CE003	S	88.0000	2 000 000	1027700185	1 779 266.67	2 000 000	12:31:30 11.03....	CE003

Отдельные столбцы окна означают следующее:

- Номер** – порядковый номер транзитного приказа в торговой системе Биржи
- Заявка** – порядковый номер заявки в торговой системе Биржи на основе транзитного приказа
- Инструмент** – код инструмента, по которому подан транзитный приказ
 - "Active"** – на основании приказа брокером подана заявка в торговую систему Биржи, выделено синим цветом
 - "Deal"** – на основании подтвержденного приказа заключена сделка, выделено зеленым цветом
- Сост.** – **"Deleted by Operator"** – приказ удален брокером, выделено красным цветом
 - "Deleted by Investor"** – приказ удален самим клиентом брокера, выделено красным цветом
 - "Deleted balance by Investor"** – приказ удовлетворен частично, выделено зеленым цветом
- Пользователь** – ID пользователя, подавшего транзитный приказ
- Остаток** – оставшееся после удовлетворения приказа количество
- Зарегистрирована** – время и дата регистрации транзитного приказа
- От кого** – код клиента брокера, подавшего приказ
- Кому** – код брокера, исполняющего приказ
- Клиентский счет** – торговый счет клиента
 - электронная подпись клиента:
- Подпись клиента** – Right – верна
 - Not right – не верна
- Дата истечения** – дата, по истечении которой заявка снимается/удаляется

Клиент брокера может подать приказ, выбрав функцию **"Транзитный приказ"** меню по нажатию правой клавиши "мыши" или нажав клавиши **Ctrl+4** по выбранному инструменту в окне **"Финансовые инструменты"**.

В поле **Торговый счет** указывается клиентский счет, в поле **"Контрагент"** – участник, выступающий в качестве брокера.

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном приказе в окне **"Транзитные приказы"** делает доступными функции:

- **"Подать заявку"** – брокер, получивший приказ на его основе подает заявку в торговую систему Биржи, параметрам заявки присваиваются значения параметров приказа. Торговый счет, указываемый брокером при вводе такой заявки, определенным брокером способом соответствует клиентскому счету.
- **"Удалить заявку"** – удалить приказ и введенную брокером на его основе заявку.

4.19. Таблица оценочных цен

В окне **"Таблица оценочных цен"** с целью справочной информации представлен перечень оценочных цен инструментов, которые могут использоваться в качестве объекта репо по операциям репо. Окно **"Таблица оценочных цен"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр"** – **"Таблица оценочных цен"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+V**.

№ /	Инструмент	Рыночная цена (с дисконтом)	Номер	Доходность	Дисконт до 30 дн., %	Дисконт 30-60 дн., %	Дисконт
1	AGKkb1	680.491300...	186	14.9006	20	20	
2	ASNDb2	83.850500...	151	15.0000	20	20	
3	ATFBb4	64.164600...	68	14.8000	20	20	
4	ATFBb5	73.350500...	76	16.3520	20	20	
5	ATFBb6	63.715600...	18	16.7994	20	20	

Каждый залоговый инструмент имеет следующие атрибуты:

- | | |
|------------------------------------|---|
| Инструмент | – код инструмента, используемого в качестве объекта репо |
| Рыночная цена (с дисконтом) | – рассчитанная системой оценочная рыночная цена (с накопленным интересом) в установленной валюте расчетов |
| Текущая рыночная | – рассчитанная системой оценочная рыночная цена (без накопленного интереса) в установленной валюте |

цена	расчетов
Номер	– номер группы объекта репо
Доходность	– оценка доходности бумаги в соответствии с принятой оценкой группы
Дисконт до 30 дн.,%	– коэффициент дисконтирования оценочной цены по объекту "автоматического" репо сроком до 30 дней
Дисконт 30-60 дн.,%	– коэффициент дисконтирования оценочной цены по объекту "автоматического" репо сроком от 30 до 60 дней
Дисконт до 60-90 дн.,%	– коэффициент дисконтирования оценочной цены по объекту "автоматического" репо сроком от 60 до 90 дней
Дней до погашения	– количество дней до погашения ценной бумаги

Оценочные цены, представленные в данном окне, служат для расчета торговой системой Биржи количества объекта репо и цен совершения сделок репо по операциям репо. Более подробную информацию смотрите в пункте **"Автоматическое" репо**.

4.20. Таблица "Параметры групп"

В окне **"Параметры групп"** представлена классификация на группы инструментов, выступающих в качестве объекта репо по операциям репо. Окно **"Параметры групп"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр" – "Параметры групп"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+Z**.

№ /	Номер	Дней до пог.	Доходность	Дисконт до 30 дн.,%	Дисконт 30-60 дн.,%	Дисконт 60-90 дн.,%	Дней ОТ погашения	Сектор	Группа	Рын./t
1	2	1 460		10	10	10	0	Repo_KZT	Repo_KZT	
2	3	10 000		5	5	5		0	Repo_KZT	Repo_KZT
3	29	2 000 000 000		30	40	50		1	Repo_KZT_Eq	Repo_CCBN
4	1	10 000		5	5	5		0	Repo_KZT	Repo_KZT
5	2	10 000		10	10	10		0	Repo_KZT	Repo_KZT

Каждая строка имеет следующие поля:

Номер	– номер группы объекта репо
Дней до пог.	– количество дней до погашения, по которому ценные бумаги данной группы относятся к соответствующей строке
Дисконт до 30 дн.,%	– оценочная доходность группы по объекту репо сроком до 30 дней
Дисконт 30-60 дн.,%	– оценочная доходность группы по объекту репо сроком от 30 до 60 дней
Дисконт 60-90 дн.,%	– оценочная доходность группы по объекту репо сроком от 60 до 90 дней
Дней ОТ погашения	– количество дней, которое в сумме со сроком заключаемой сделки репо не должно превышать оставшийся срок до погашения ценной бумаги

- указывает на то, что в качестве оценки ценной бумаги используется не оценочная доходность, а рыночная (определенная другими способом) или средневзвешенная цена данной бумаги в торговой системе Биржи:
- Рын./Средневз.** – "Y" – доходность, "H" – ручная оценка, "K" – коэффициент, "M" – средневзвешенный курс
- Сектор** – указывает на принадлежность к сектору репо
- Группа** – указывает на принадлежность к группе репо
- Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранной группе делает доступными функции:
- **"Добавить" (Ins)** – используется операторами для добавления новой группы;
 - **"Удалить" (Del)** – используется операторами для удаления группы;
 - **"Свойства" (Alt+Enter)** – предоставляет оператору возможность определить свойства строки группы соответствующим образом.

Резерв дней – соответствует полю **"Дней ОТ погашения"** в окне **"Параметры групп"**

Более подробную информацию смотрите в пункте **"Автоматическое репо"**.

4.21. Таблица обязательных котировок

Торговая система Биржи позволяет осуществлять контроль за обязательствами маркет-мейкеров по объявлению и поддержанию обязательных котировок с помощью окна **"Таблица обязательных котировок"** и соответствующих сообщений торговой системы Биржи.

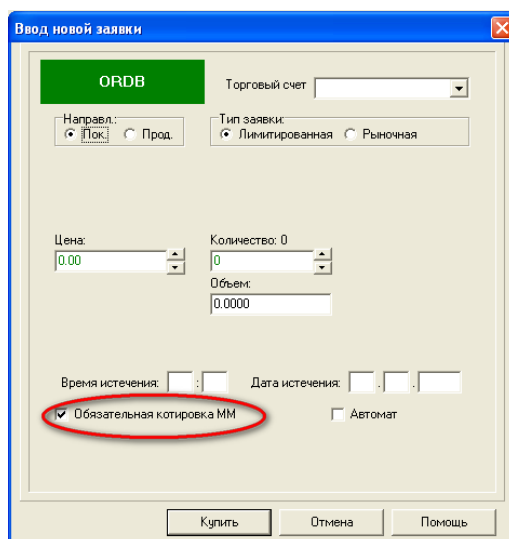
При проведении торгов методом непрерывного встречного аукциона торговая система Биржи допускает возможность ввода в нее следующих специальных заявок:

- предварительных заявок – заявок, принимаемых Биржей до начала торговой сессии;
- двойных заявок – заявок на покупку и на продажу финансового инструмента.

Для облегчения деятельности маркет-мейкеров в торговую систему Биржи встроен механизм подачи предварительных периодических двойных заявок, позволяющий заблаговременно формировать обязательные котировки маркет-мейкеров и ежедневно автоматически объявлять их в торговой системе Биржи от имени маркет-мейкеров в период приема предварительных заявок.

Хотя названный механизм разработан специально для маркет-мейкеров, он может также использоваться и другими членами Биржи (в зависимости от настроек торговой системы Биржи).

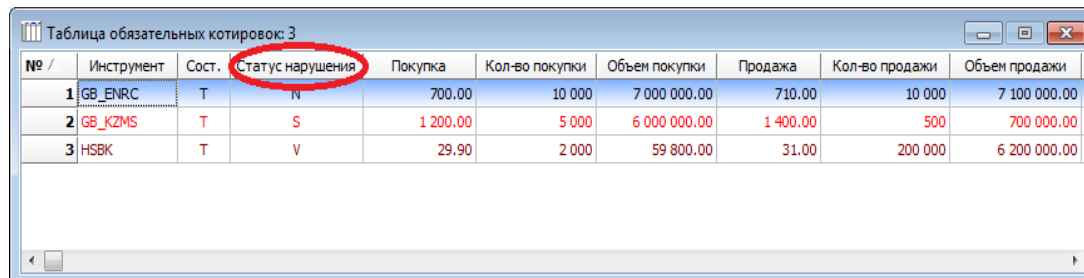
Маркет-мейкер может определить свою заявку как обязательную котировку маркет-мейкера, активизировав в ее форме опцию **"Обязательная котировка ММ"**.



Для контроля своих обязательных котировок маркет-мейкеру необходимо открыть окно **"Таблица обязательных котировок"** одним из следующих способов:

- выбрав в главном меню **"Просмотр"** – **"Таблица обязательных котировок"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+K**.

В окне **"Таблица обязательных котировок"** приводится список финансовых инструментов, по которым член Биржи является маркет-мейкером и, соответственно, обязан объявлять и поддерживать обязательные котировки.



№ /	Инструмент	Сост.	Статус нарушения	Покупка	Кол-во покупки	Объем покупки	Продажа	Кол-во продажи	Объем продажи
1	GB_ENRC	T	N	700.00	10 000	7 000 000.00	710.00	10 000	7 100 000.00
2	GB_KZMS	T	S	1 200.00	5 000	6 000 000.00	1 400.00	500	700 000.00
3	HSBK	T	V	29.90	2 000	59 800.00	31.00	200 000	6 200 000.00

Формирование указанного списка осуществляется маклером Биржи, который устанавливает по отдельным финансовым инструментам, входящим в такой список, следующие параметры:

- **минимальное количество** (минимальный размер) или **минимальный объем** обязательной котировки;
- **минимальный спрэд** между обязательными котировками на продажу и покупку финансового инструмента, который может выражаться:
 - в процентах ("Мин. спрэд, %") между ценами продажи и покупки финансового инструмента
 - в разнице доходности ("Мин. спрэд, YTM¹⁰") финансового инструмента исходя из цен его продажи и покупки
 - в абсолютном выражении ("Мин. спрэд") разницы между ценами продажи и покупки финансового инструмента

¹⁰ Аббревиатура английского словосочетания "yield to maturity" ("доходность к погашению").

Примечание Расчет значения спреда вне зависимости от способа его выражения осуществляется от цены наилучшей обязательной котировки маркет-мейкера на покупку.

Поле **"Статус нарушения"** позволяет отслеживать текущий статус обязательной котировки, который может принимать следующие обязательные требования:

- **"N"** – обязательная котировка соответствует требованиям;
- **"S"** – обязательная котировка не соответствует требованиям в части минимального спреда;
- **"V"** – обязательная котировка не соответствует требованиям в части минимального объема.

С помощью окна **"Таблица обязательных котировок"** маркет-мейкер может просматривать лучшие значения собственных обязательных котировок, а также наблюдать, насколько данные котировки соответствуют его обязательствам по минимальному количеству (размеру) или минимальному объему обязательных котировок, а также по минимальному спреду между обязательными котировками на продажу и покупку финансового инструмента:

- если какая-либо строка в окне **"Таблица обязательных котировок"** выделена **коричневым цветом**, это означает, что маркет-мейкер не соблюдает свои обязательства по минимальному количеству (размеру) или минимальному объему обязательной котировки;
- если какая-либо строка в окне **"Таблица обязательных котировок"** выделена **красным цветом**, это означает, что маркет-мейкер не соблюдает свои обязательства по минимальному спреду между обязательными котировками на продажу и покупку финансового инструмента.

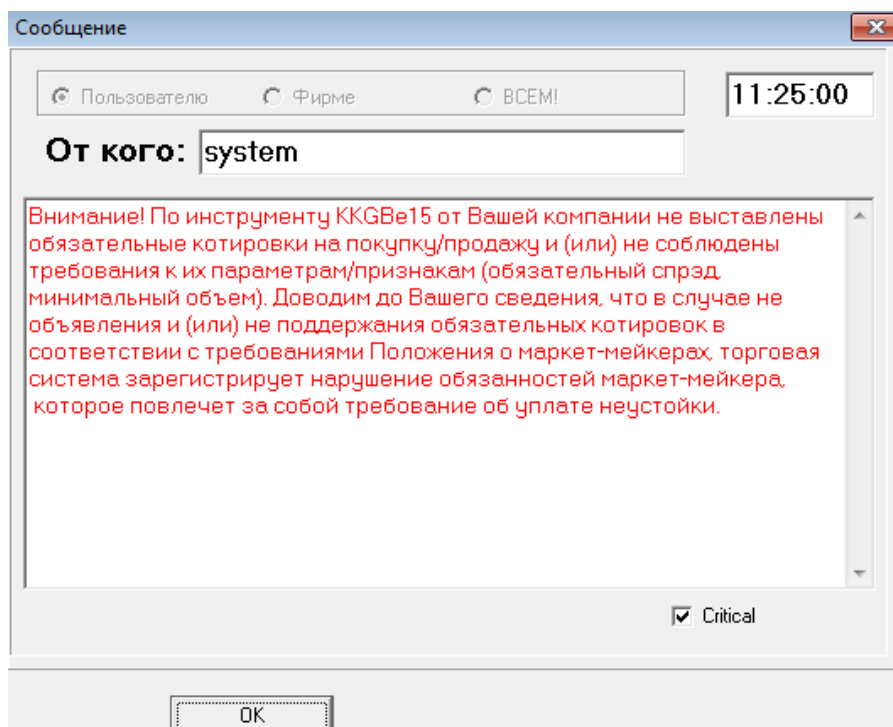
Примечание В окне **"Таблица обязательных котировок"** указываются лучшие значения обязательных котировок, объявленных самим маркет-мейкером. Наилучшие цены заявок других участников торгов доступны для просмотра в окнах **"Финансовые инструменты"** или **"Котировки"** (по выбранному финансовому инструменту).

Окно **"Таблица обязательных котировок"** может также использоваться для подачи двойных заявок (пункт **"Двойные заявки"**).

Для того чтобы просмотреть параметры обязательной котировки маркет-мейкера по какому-либо финансовому инструменту, необходимо в окне **"Таблица обязательных котировок"** подвести курсор к строке, соответствующей данному инструменту, и нажать правую клавишу мыши. В результате появится всплывающее окно, в котором следует выбрать функцию **"Свойства"** ("горячие" клавиши – **Alt+Enter**).

Фирма	Мин. кол-во	Мин. спред, %
NSBK_	0	0.0000
Инструмент	Мин. объем	Мин. спред, YTM
USDKZT_TOD	500000.00	0.0000
% отклонения цены посл. сделки	Дата начала	Мин. спред
0.0000		0.1000
% предельного отклонения цены	Дата окончания	
0.0000		
OK	Cancel	

В ходе контроля за обязательными котировками маркет-мейкеров торговая система Биржи автоматически передает маркет-мейкеру сообщение о нарушении им своих обязательств:



Указанное сообщение торговой системы Биржи передается маркет-мейкеру в течение одной минуты (в зависимости от настройки бэк-офиса торговой системы Биржи) после возникновения несоответствия между обязательной котировкой маркет-мейкера и его обязательствами и периодически дублируется торговой системой Биржи до устранения такого несоответствия.

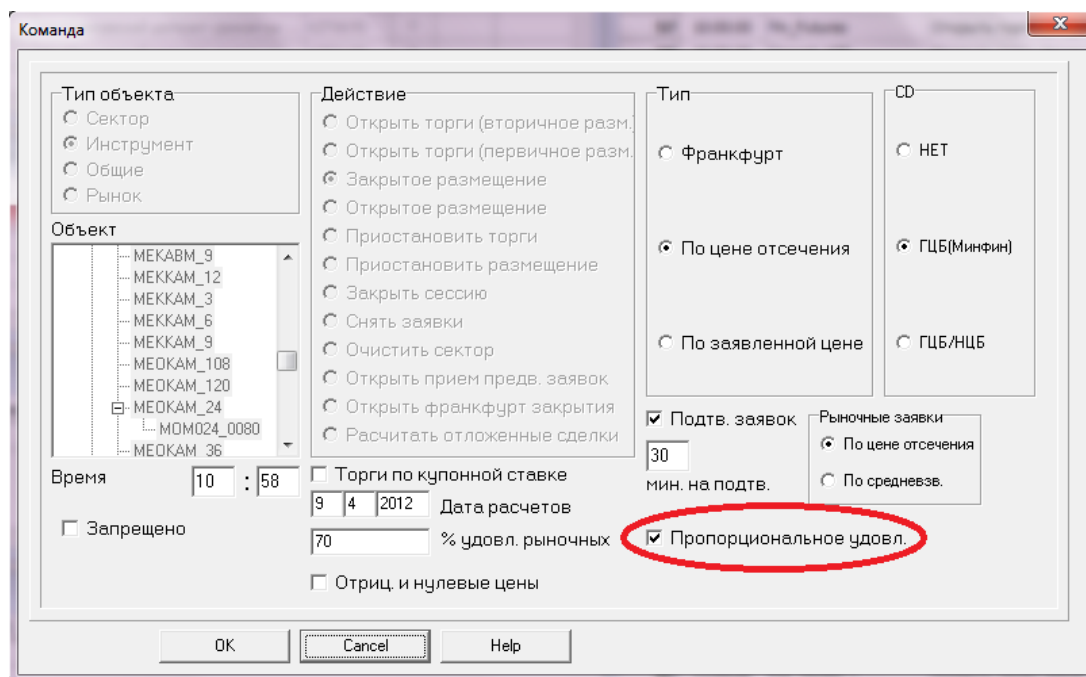
4.22. Расписание торгов

Окно **"Расписание торгов"** содержит информацию о событиях, наступающих для объектов торговой системы Биржи в определенные моменты времени. Окно открывается через главное меню **"Просмотр" – "Расписание торгов"**.

№ /	Время	Объект	Действие
71	11:05:00	INT_Bonds	Открыть прием предв. зая...
72	11:05:00	IG_Bonds	Открыть прием предв. зая...
73	11:05:00	MBonds	Открыть прием предв. зая...
74	11:05:00	Eqs_Liq_III	Открыть прием предв. зая...
75	11:05:00	Eqs_Liq_I	Открыть прием предв. зая...
76	11:05:00	IF_List_Liq	Открыть прием предв. зая...
77	11:05:00	Int_Debts_List	Открыть прием предв. зая...
78	11:05:00	IF_List_NLiq	Открыть прием предв. зая...
79	11:05:00	Debts_Nonlist	Открыть прием предв. зая...
80	11:05:00	Eqs_Liq_II	Открыть прием предв. зая...
81	11:10:00	RDGZp	Расчитать отложенные сде...
82	11:12:00	Debts_List	Очистить сектор

Строки окна – события редактируются операторами, которые по нажатию клавиши **Insert** могут установить новые события для сектора рынка или финансового инструмента в определенное время.

Редактирование свойств событий осуществляется выбором функции меню по нажатию правой клавиши "мыши" или клавиш **Alt+Enter**.



в зависимости от установленного флага оператор может выполнить следующие действия:

Действие

- открыть торги (вторичное размещение) – вторичное размещение определенных инструментов
- открыть торги (первичное размещение) – первичное размещение определенных инструментов
- закрытое размещение – открытие специализированных торгов закрытым способом подачи заявок
- открытое размещение – открытие специализированных торгов открытым способом подачи заявок
- приостановить торги – приостановление торгов в определенное время
- приостановить размещение – приостановление специализированных торгов в определенное время
- закрыть сессию – закрытие торгов определенными инструментами либо по выбранным секторам
- снять заявки – снятие/удаление всех заявок по определенным инструментам либо по выбранным секторам
- очистить сектор – очистка/удаление сделок по определенным инструментам либо по выбранным секторам
- открыть прием предв. заявок – открытие приема предварительных заявок по выбранным инструментам либо по секторам
- открыть франкфурт закрытия – открытие франкфурта закрытия по выбранным инструментам либо по секторам для установления репрезентационной цены

Действие

в зависимости от установленного флага способы удовлетворения заявок могут быть следующими:

Тип

- способ удовлетворения заявок методом

		<p>франкфуртского аукциона</p> <ul style="list-style-type: none"> ● способ удовлетворения заявок по цене отсечения ● способ удовлетворения заявок по заявленной цене <p>для оператора доступна опция "CD", имеющая следующие возможные варианты выбора:</p> <ul style="list-style-type: none"> ● "НЕТ" – приказы на регистрацию сделок для Центрального депозитария не формируются ● ГЦБ (Минфин) – используется в случае регистрации сделок при первичном размещении государственных ценных бумаг. Расчеты осуществляются через Центральный депозитарий. Деньги в оплату размещенных ценных бумаг зачисляются на счет Министерства финансов Республики Казахстан (формат 565) ● ГЦБ/НЦБ – применяется при передаче приказов на регистрацию сделок купли/продажи ценных бумаг. Расчеты проводятся через Центральный депозитарий. Купленные ценные бумаги либо деньги в оплату проданных ценных бумаг, зачисляются на счет покупателя/продавца, указанный маклером при регистрации сделок (форматы 526 или 564)
CD	–	
Запрещено	–	при установлении флага действия блокируются
Торги по купонной ставке	–	при наличии флага предметом торга на специализированных торгах является купонная ставка
Дата расчетов	–	дата расчетов сделок
% удовл. рыночных	–	количество удовлетворения рыночных заявок в процентном соотношении
Отриц и нулевые цены	–	при установлении флага разрешается подавать заявки с отрицательными и нулевыми ценами
Подтв. заявок	–	установление флага означает обязательное подтверждение участниками системы подтверждения заявок, поданных по таким счетам
Мин. на подтв.	–	количество минут, дающихся участнику системы подтверждения для подтверждения поданной заявки
Пропорциональное удовлетворение	–	способ удовлетворения поданных заявок по цене равной цене отсечения пропорционально их объемам
Рыночные заявки	–	способ удовлетворения рыночных заявок по цене отсечения либо по средневзвешенной цене

4.23. **Депозитарий**

Окно **"Депозитарий"** содержит информацию о сообщениях, отправленных Центральному депозитарию и полученных от него, на текущую дату и доступно для просмотра только операторам. Окно открывается через главное меню **"Просмотр"** – **"Депозитарий"**.

Депозитарий: 40, ОК: 16									
№ /	Тип сообщения	Референс	Связанный Референс	Послано	Получено	Инструмент	Номер	Сост.	Комментарий
1	MT547 - приказ на регистрацию операции откр...	60917457		06.03.2014 12:43:51	06.03.20...		2 051 178	Неверный фор...	
2	MT545 - приказ на регистрацию операции откр...	60962119		19.03.2014 12:18:34	20.03.20...		2 052 024	...	
3	MT545 - приказ на регистрацию операции откр...	61009785		02.04.2014 15:52:42	02.04.20...		2 052 163	...	
4	MT545 - приказ на регистрацию операции откр...	61009794		02.04.2014 16:06:19	02.04.20...		2 052 162	Ok	
5	MT526 - приказ на регистрацию сделки купли/п...	6345		21.08.2014 10:14:28	MUM156_0002	2 074 385	...	
6	MT565 - приказ на регистрацию сделки первичн...	10449		05.09.2014 11:54:16	MUM180_0001	2 074 898	...	

- Тип сообщения** – код и краткое описание сообщения
- Референс** – номер документа отправителя
- Связанный референс** – номер документа, на который ссылается данный документ
- Номер** – номер сделки
- Послано** – время и дата отправки файла на расчет в Центральный депозитарий
- Получено** – время и дата получения файла на расчет в Центральном депозитарии
- Сост.** – результаты о состоянии сделки, полученные с Центрального депозитария
- Комментарий** – комментарий отправителя

4.24. Валюты

Окно "**Валюты**" содержит информацию об официальных и иных курсах используемых иностранных валют. Окно "**Валюты**" можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню "**Просмотр**" – "**Структура рынка**" – "**Валюты**";
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+C**.

№ /	Наименование	Полное наименование	Установленный курс
1	KZT	Казахстанский тенге	1.0000
2	USD	Доллар США (курс НБ)	155.1000
3	EUR	Евро	212.2562
4	DEM	Марка ФРГ	88.7632
5	GBP	Английский фунт стерлингов	248.8882
6	EUR_NB	Евро (курс НБ)	211.4200
7	JPY	Йена	1.5792
8	USDKZT_TOD	Доллар США	155.1000

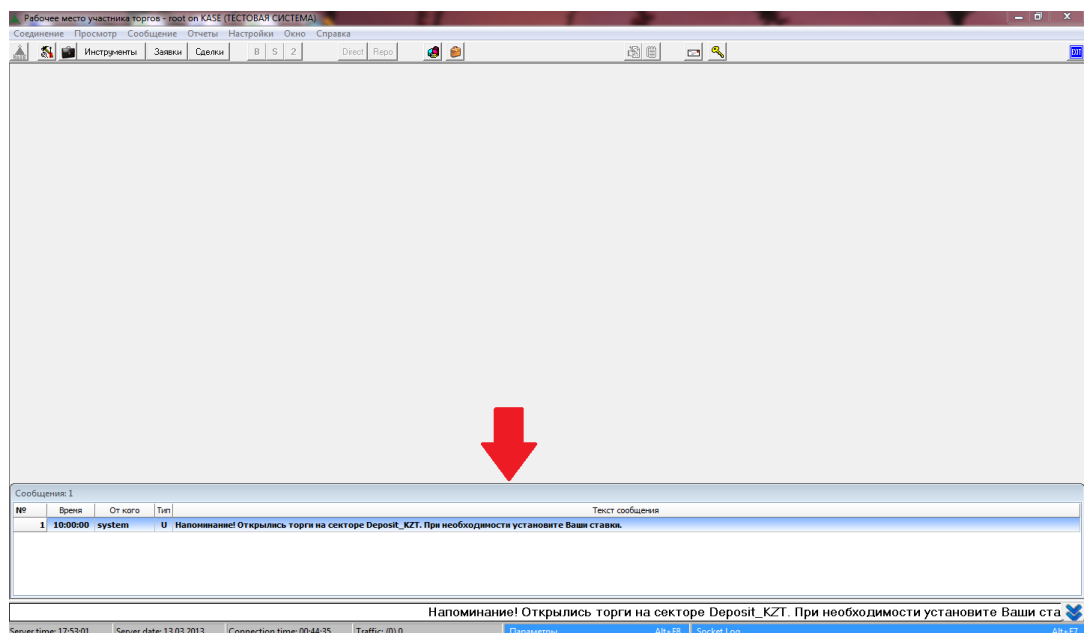
Курсы валют устанавливаются Биржей ежедневно исходя из данных торгов на валютном рынке.

Примечание Обновление курсов валют на международных облигациях, выпущенных в иностранной валюте, осуществляется через таблицу **«Валюты»** (Просмотр – Структуры рынка – Валюты) и зависит от настроек, установленных в свойствах инструмента (Инструмент – Свойства (параметры инструмента) – вкладка Валюты – Способ пересчета):

- если выбран пункт **«По установленному курсу»**, то курс берется из поля **«Установленный курс»** по строкам KZT, USD, EUR, DEM, GBP, JPY, CHF.
- если выбран пункт **«По курсу биржи»**, то курс берется из средневзвешенного значения по итогам утренней сессии соответствующего инструмента, то есть USDKZT_TOD, EURKZT_TOD, RUBKZT_TOD.


4.25. Сообщения

Все сообщения, полученные пользователем за текущий день, можно просмотреть в окне **"Сообщения"**, расположенное в нижней части экрана.



В бегущей строке, размещенной ниже окна сообщений, отображаются непрочитанные сообщения. После прочтения данное сообщение в бегущей строке отображаться не будет.

Окно **"Сообщения"** можно открыть следующими способами:

- выбрав в главном меню **"Просмотр" – "Сообщения"**;
- нажав "горячие" клавиши **Ctrl+B**;
- развернув окно **"Сообщения"** путем нажатия значка .

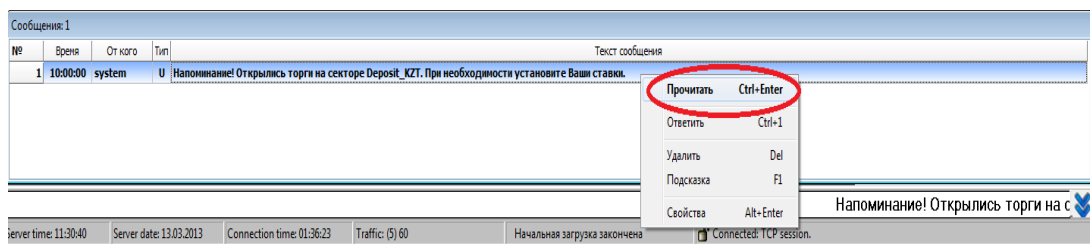
Каждое сообщение в окне **"Сообщения"** представлено одной строкой.

№ /	Время	От кого	Тип	Текст сообщения
1	10:00:04	system	U	Напоминание! Открылись торги на секторе Deposit_KZT. При необходимости установите Ваши ставки.
2	10:05:43	nailya	A	Вниманию членов биржи! По инструменту BRKZe3 с 10:05 до 10:07 будет снят преодолительный лимит отклонения цены от посл...
3	10:10:14	rinata	A	Вниманию членов биржи! По инструменту CCBNb13 с 10:10 до 10:12 будет снят преодолительный лимит отклонения цены от посл...
4	11:14:45	nailya	A	Вниманию членов биржи! По инструменту BTAIb9 с 11:14 до 11:16 будет снят преодолительный лимит отклонения цены от посл...
5	12:00:24	nailya	A	Вниманию членов биржи! По инструменту BTA5b4 с 12:00 до 12:02 будет снят преодолительный лимит отклонения цены от посл...
6	12:17:06	nailya	A	Вниманию членов биржи! По инструменту KKGbP с 12:17 до 12:19 будет снят преодолительный лимит отклонения цены от после...
7	14:53:24	system	U	Открылся 10-минутный франкфуртский аукцион по инструменту KKGbP в связи с намерением участников заключить сделку ...
8	14:58:31	rinata	A	Вниманию членов биржи! По инструменту RDGZ, H5BK, H5BKp с 14:58 до 15:00 будет снят преодолительный лимит отклонения це...

В строке показываются время получения, отправитель, текст и статус сообщения: **"U"** – (отправлено системой), **"A"** – (отправлено маклером). Если строка сообщения выделена жирным шрифтом, сообщение не было прочитано пользователем.

Нажатие правой клавиши "мыши" на выбранном сообщении открывает доступ к функциям:

- **"Прочитать"** – просмотр сообщения;
- **"Ответить"** – написать отправителю ответное сообщение;
- **"Refresh"** – при помощи данной функции пользователь может пометить выбранное сообщение как непрочитанное, при следующем входе в торговую систему Биржи оно автоматически появится на экране;
- **"Удалить"** – удаление сообщения;
- **"Свойства"** – просмотр текста сообщения.



Двойное нажатие левой кнопкой мыши по непрочитанному сообщению, выделенному жирным шрифтом, также позволяет открыть его.

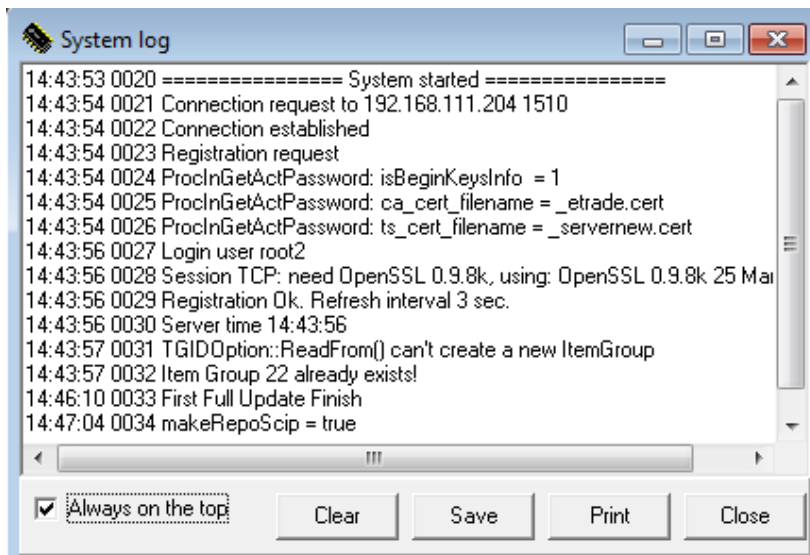
Для закрытия окна **"Сообщения"** необходимо кликнуть на иконку .

Внимание! В автоматическом режиме сообщения на экран выводиться не будут. Настоятельно рекомендуется открывать окно **"Сообщения"** для просмотра всех непрочитанных сообщений.

4.26. Системная информация

В окне **"System log"** фиксируется протокол обмена информацией клиента с сервером, то есть системная информация, доступная пользователю. Окно **"System log"** можно вывести на экран следующими способами:

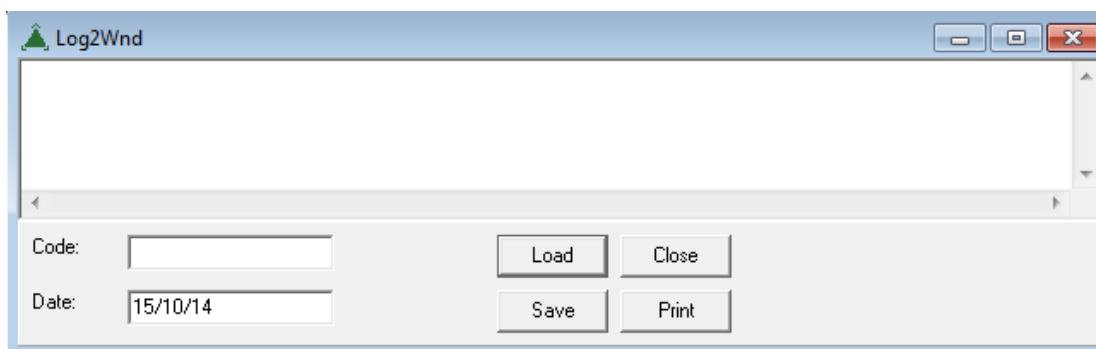
- выбрав в главном меню **"Просмотр"** – **"System log"**;
- нажав клавишу **F7**.



Действия доступные пользователю в окне определяются соответствующими кнопками:

- Clear** – очистить информацию
- Save** – сохранить информацию в текстовом файле
- Print** – отправить протокол на печать
- Close** – закрыть окно
- Always on the top** – данное окно отображается поверх всех окон терминала торговой системы Биржи

Одновременное нажатие клавиш **Ctrl+Alt+F7** позволяет просмотреть расширенный протокол, в котором также фиксируются все действия пользователей на локальном компьютере на определенную дату, в том числе подача заявок.



Данный протокол доступен для просмотра по специальному кодовому слову только операторам.

- Code** – кодовое слово, вводимое оператором
- Load** – загрузить

4.27. Система подтверждения

Система подтверждения является составным компонентом торговой системы Биржи, предназначенным для подтверждения заключенных в торговой системе Биржи сделок в целях осуществления расчетов по ним либо для отказа в таком подтверждении.

Предупреждение Работать с системой подтверждения могут только те организации, которые зарегистрированы Биржей в качестве участников данной системы, и те физические лица – пользователи системы подтверждения, сведения о которых были предоставлены бирже по форме Приложения 3 к Общим условиям расчетов по итогам торгов ценными бумагами.

Подтверждение или отказ в подтверждении сделок

В открытом окне "**Сделки**" отражаются заключенные сделки, которые могут быть подтверждены пользователем системы подтверждения или в подтверждении которых данный пользователь вправе отказать, а также заключенные сделки, по которым было осуществлено подтверждение или произведен отказ в подтверждении.

№	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Пользователь	Торговый счет	Зарегистрирована	Сост.
7	DTJLb1	2 084 355	5 51...	B	84.0000	1 000	-	-	15.10.2014 15:41:27	Waits for Confirm
8	DTJLb1	2 084 355	5 51...	S	84.0000	1 000	-	-	15.10.2014 15:41:27	Waits for Confirm
10	KKGBe21	2 084 354	5 51...	S	118.0000	1 000	-	-	14.10.2014 15:19:34	Done
9	KKGBe21	2 084 354	5 51...	B	118.0000	1 000	-	-	14.10.2014 15:19:34	Done
11	KKGBe22	2 084 352	5 51...	S	107.7026	1 000	-	-	14.10.2014 14:44:06	Done
12	KKGBe22	2 084 352	5 51...	B	107.7026	1 000	-	-	14.10.2014 14:44:06	Done
5	DTJLb1	2 084 348	5 51...	B	83.0000	2 000	-	-	08.10.2014 12:23:37	Rejected by Partner
6	DTJLb1	2 084 348	5 51...	S	83.0000	2 000	-	-	08.10.2014 12:23:37	Rejected by Investor
3	DTJLb1	2 084 347	5 51...	B	83.0000	2 000	-	-	08.10.2014 12:22:22	Done

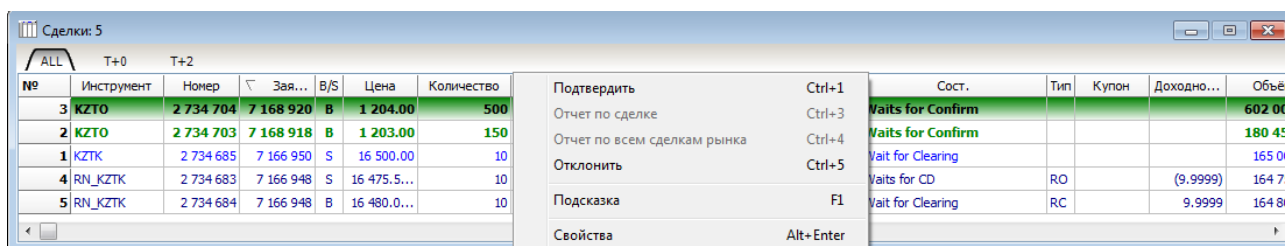
В столбце "**Сост.**" ("**Состояние**") указывается состояние заключенных сделок:

- **Waits for Confirm** – сделка, находящаяся в состоянии ожидания своего подтверждения данным пользователем системы подтверждения;
- **Waits for Partner** – сделка, ожидающая своего подтверждения со стороны другого контрагента;
- **Waits for CD** – подтвержденная сделка, переданная на исполнение (осуществление расчетов по ней);
- **Done** – исполненная сделка на рынке "автоматического" репо (осуществление расчетов по которой завершено);
- **Done** – исполненная сделка репо (осуществление расчетов, по которой завершено);
- **Rejected by Investor** – сделка, в подтверждении которой данным пользователем системы подтверждения было отказано;
- **Rejected by Partner** – сделка, в подтверждении которой было отказано со стороны другого контрагента;
- **"Rejected by CD (cash. problem)", "Rejected by CD (sec. problem)"** – неисполненная сделка (осуществление расчетов, по которой было невозможным, например, в виду отсутствия у какой-либо из ее сторон необходимого количества денег или финансовых инструментов).

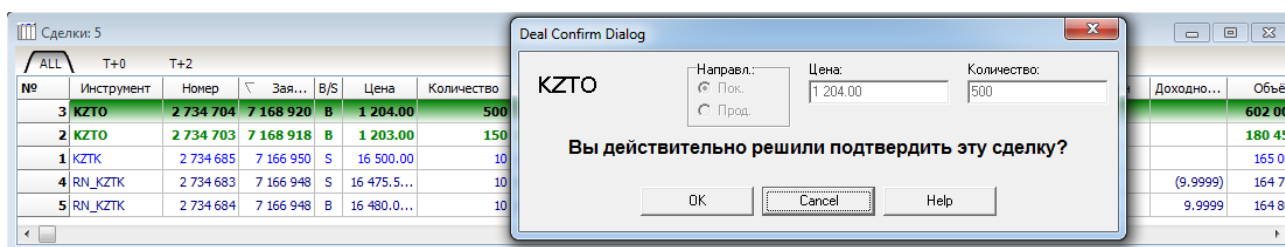
Примечание Неисполненная сделка по обоюдному согласию ее сторон может быть повторно передана Бирже на исполнение.

Чтобы подтвердить заключенную сделку или отказать в ее подтверждении, необходимо подвести курсор к строке, соответствующей данной сделке, и нажать правую клавишу "мыши". В результате этих действий появится всплывающее окно, содержащее две основные функции – "**Подтвердить**" и "**Отклонить**".

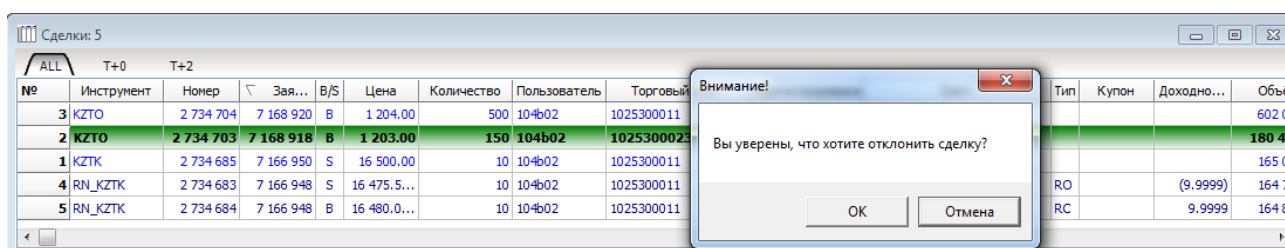
Сделки, по которым кастодианом не было выполнено никаких действий, по команде в расписании автоматически подтверждаются.



Для того чтобы подтвердить заключенную сделку, следует выбрать функцию **"Подтвердить"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+1**).



Для того чтобы отказать в подтверждении заключенной сделки, следует выбрать функцию **"Отклонить"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+5**).



Внимание! Если заключенная сделка находится в состоянии **"Rejected by Partner"**, то это состояние более никем не может быть изменено. Пользователям системы подтверждения рекомендуется тщательно проверять параметры заключенной сделки, прежде чем отказывать в ее подтверждении.

В этом же окне **"Сделки"** пользователи системы подтверждения могут наблюдать состояние сделок открытия репо, которые относятся к операциям репо, осуществляемым "автоматическим" способом, а именно тех сделок открытия репо, по которым производится замена предметов операции репо на другие в соответствии с Правилами осуществления операций репо.

Состояние таких сделок открытия репо указывается в столбце **"Сост."** ("Состояние"):

- **Waits for change note** – сделка открытия репо, по которой производится замена предмета операции репо на другой;
- **Waits for agreement** – сделка открытия репо, по которой произведена замена предмета операции репо на другой и которая находится в состоянии ожидания согласия с такой заменой со стороны покупателя репо.

Подтверждение позиций по сделкам, заключенным по схеме T+2

По позиционным счетам, образованным сделками по торговым счетам системы подтверждения, кастодиан имеет возможность дать расчетное подтверждение. Эта операция реализуется в торговой системе путем выбора пункта **"Подтвердить позицию"** в контекстном меню по позиционному счету. По умолчанию позиция находится в статусе **"Ожидает подтверждения"**.

№ /	Наименование	Организация	Треб.под.	Авто	Забл.	Собственн.	Показывать позиции	Проверка позиций	Управляемая позиция	Статус СПС(Т+2)	Единый Лимит
1	1025300000	АО "Компа...						X			10 434 099.75
2	1025300011	АО "Компа...	X					X		Ожидает подтверждения	858 979.04
3	1025300012	АО "Компа...						X			10 000 794.76
4	1025300013	АО "Компа...						X			317 595.75
5	1025300014	АО "Компа...						X			7 043 262.33
6	1025300015	АО "Компа...						X			183 991.25
7	1025300023	АО "Компа...	X					X		Ожидает подтверждения	19 973 683.74
8	1025300025	АО "Компа...						X			14 725.00
9	1025300026	АО "Компа...						X	X		2 528.82
10	1025300027	АО "Компа...						X	X		0.00
11	1025300030	АО "Компа...						X	X		0.00
12	1025300031	АО "Компа...						X	X		4 342 658.63
13	1025300032	АО "Компа...						X	X		0.00
14	1025300040	АО "Компа...						X	X		0.00

При выборе пункта **"Подтвердить позицию"** позиционный счет переходит в статус **"Позиция подтверждена"**. Все сделки, образовавшие подтвержденную позицию, переводятся в статус **"Waits for CD"**.

В случае несогласия, кастоди выбирает пункт **"Отклонить позицию"**. При этом изменений в забранном обеспечении не производится, а сделки, образовавшие данную позицию, переходят в статус **"Rejected by Investor"**.

Подтвердить или отвергнуть позиции по сделке кастоди может в день T0 и T1.

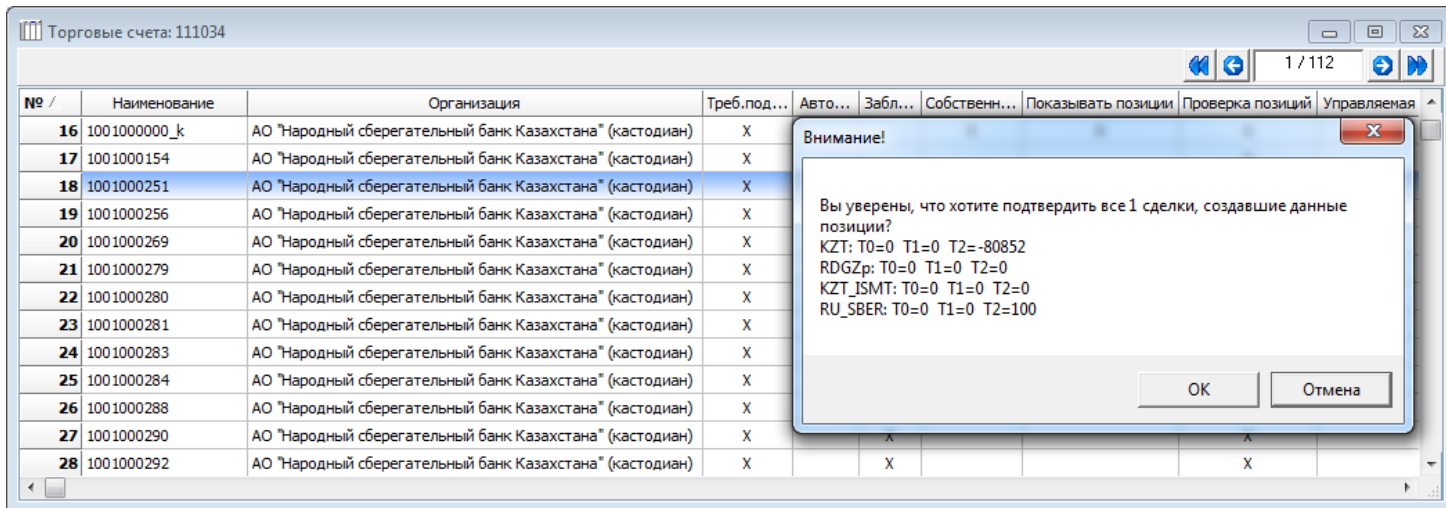
По позиционным счетам, образованным сделками по торговым счетам без системы подтверждения, процедура подтверждения позиций производится автоматически по расписанию в день T1.

Подтверждения нетто-позиции клиента по определенному счету

По торговым счетам, системы подтверждения, кастодиан имеет возможность дать подтверждение нетто-позиции клиента. Эта операция реализуется в торговой системе путем выбора пункта "Подтвердить сделки" в контекстном меню по торговому счету.

№ /	Наименование	Организация	Проверка позиций	Управляемая позиция	Статус СПС(Т+2)	Единый Лимит
16	100100000_k	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
17	1001000154	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
18	1001000251	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
19	1001000256	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
20	1001000269	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
21	1001000279	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
22	1001000280	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
23	1001000281	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
24	1001000283	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)				
25	1001000284	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X			
26	1001000288	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X			
27	1001000290	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X	X		
28	1001000292	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X	X		
29	1001000293	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X			
30	1001000294	АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (кастодиан)	X	X		

После нажатия «Подтвердить сделки» появляется окно с данными нетто-позиции в разрезе дней.



Подтвердить нетто-позиции клиента кастоди может в день T0 и T1.

Подтверждение сделок, заключенных по схеме T+2

Сделки с расчетами T+2 по умолчанию формируются в статусе **"Wait for Clearing"**. В случае использования торговых счетов Системы подтверждения такие сделки формируются в статусе **"Waits for Confirm"** (**"Waits for Partner"**, для контрагента, работающего без системы подтверждения).

Если кастодиан согласен с параметрами сделки, заключенной брокером по его торговому счету, то он проставляет по сделке статус **"Confirmed"** – сделка переводится в статус **"Wait for Clearing"**, в противном случае кастоди отвергает сделку, выставляя статус **"Rejected by Investor"**. Подтвердить или отвергнуть сделки кастоди может в день T0 и T1.

Сделки, по которым кастодианом не было выполнено никаких действий, по команде в расписании автоматически подтверждаются в день T1.

Брокер имеет возможность изменить торговый счет в сделке со статусом **"Rejected by Investor"**. Если новый измененный торговый счет также контролируется системой подтверждения, то сделка снова переходит в статус **"Waits for Confirm"**, если счет без системы подтверждения – в **"Wait for Clearing"**. При смене счета производится разблокировка забранного обеспечения (маржевого или полного) на старом торговом счете и соответствующая блокировка на новом.

По отвергнутой кастодианом сделке брокер имеет возможность сделать запрос на расторжение сделки путем выставление статуса **"Wait for Cancellation"**.

При переводе сделки в статус **"Wait for Cancellation"** контрагент получает сообщение, сгенерированное торговой системой, об имеющихся у него возможностях: 1) расторгнуть сделку (перевести в статус **"Cancelled"**) 2) сообщить о готовности исполнить сделку (перевести в статус **"Rejected by Investor"**).

При переводе сделки в статус **"Cancelled"** блокировка обеспечения по ней с обеих сторон снимается.

Подтверждение заявок, поданных при проведении специализированных торгов.

При проведении специализированных торгов поданные заявки, при удовлетворении которых будут использоваться торговые счета, контролируемые участниками системы подтверждения, признаются принятыми Биржей только в случае подтверждения данных заявок в течение определенного Регламентом торгов времени.

Чтобы подтвердить заявку или отказать в ее подтверждении, необходимо в окне **"Заявки"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+Q**) подвести курсор к строке, соответствующей

данной заявке, и нажать правую клавишу "мыши". В результате этих действий появится всплывающее окно, содержащее функции **"Подтвердить"** и **"Отклонить"**.

Заявки: 137											
№	Инструмент	Номер	B/S	Цена	Количество (н...	Объем (нач.)	Купон	Доходно...	Количество (оста...	Объем (оста...	Сост.
137	MUM180_0002	5 51...	B	100.0000	2	2 000.00					Ожидает подтверждения
5	DTJLb1	5 51...	B	85.0000	1 000	850.00					Лимитированная
135	ADLA	5 51...	S	133.90	1 000	133 900.00					Лимитированная*
136	ADLA	5 51...	B	130.00	1 000	130 000.00					Лимитированная*
133	ККGBр	5 51...	S	103.00	1 000 000	103 000 000...					Лимитированная*
134	ККGBр	5 51...	B	100.00	1 000 000	100 000 000...					Лимитированная*
131	AESOb1	5 51...	S	101.9792	1 000	1 019.79					Лимитированная*
33	ККGBе21	5 51...	B	118.0000	1 000 000	187 620 000...					Лимитированная*
32	ККGBе21	5 51...	S	126.3359	1 000 000	200 874 081...					Лимитированная*
31	ККGBе21	5 51...	S	125.0000	1 000	198 750.00					Лимитированная

Для того чтобы подтвердить заявку, следует выбрать функцию **"Подтвердить"** ("горячие клавиши" – **Ctrl+2**).

Для того чтобы отказать в подтверждении заявки, следует выбрать функцию **"Отклонить"** ("горячие клавиши" – **Ctrl+3**).

4.28. История зачислений/списаний

В таблице "История зачислений и списаний" отображаются изменения на позиционных счетах пользователя.

История зачислений/списаний: 6						
№ /	Торговый счет	Наименование	Зарегистрирована	Тип операции	Входящая	Сост.
1	1025400000	KZT	20.11.2014 13:47:07	Списание по запросу на уменьшение количества о...	- 238 500.00	Ok
2	1025400000	KZT	20.11.2014 13:47:08	Списание по запросу на уменьшение количества о...	-3 732 272.90	Ok
3	1025400000	KZP01Y06D707	20.11.2014 13:48:11	Изменение через Терминал	- 700.00	Ok
4	1025400000	KZT	20.11.2014 14:10:04	Установка входящей позиции по ведомости от ЦД	154 824 133.26	Ok
5	1025400000	KZT_CLNT	20.11.2014 14:10:04	Установка входящей позиции по ведомости от ЦД	243 833 802.54	Ok
6	1025400000	KZT	20.11.2014 14:10:07	Изменение количества по уведомлению от ЦД	5 000 000.00	Ok

При установке входящей позиции, зачислении или списании средств на денежных счетах от Центрального Депозитария пользователь получает соответствующее сообщение.

Сообщения: 2				
№ /	Время	От кого	Тип	Текст сообщения
1	14:15:49	system	U	Ваш денежный позиционный счет был изменен на -238500.00
2	14:15:47	system	U	Ваш денежный позиционный счет был изменен на -3732272.90

Глава 5. Права

Права на объект означают возможность субъекта торговой системы Биржи проводить определенные операции с данным объектом торговой системы Биржи.

Права предоставляются оператором фирме и пользователям данной фирмы. Права фирмы имеют приоритет над правами пользователей фирмы (если у фирмы нет прав на объект торговой системы Биржи, то даже при наличии их у пользователя данной фирмы, он не может воспользоваться своими правами).

5.1. Права фирмы

Права фирмы можно просмотреть только через окно **"Фирмы"** следующими способами:

- в окне **"Фирмы" – "Права"**;

- нажав "горячие клавиши" **Alt+1**.

Права: 8: ABNAA							
№ /	Объект	View	Modf	Close	Mngr	Tran	Apnd
1	M> DEPOS	Y	Y		-	-	-
2	S> Deposit_KZT	Y	Y		-	-	-
3	M> Equities	Y	Y		-	-	-
4	M> ForEx	Y	Y		-	-	-

В окне **"Права фирмы"** оператор может редактировать существующие права, добавлять новые или удалять некоторые путем выбора соответствующих функций из меню и клавиш **Alt+Enter, Insert, Delete**.

Объектом прав для фирм могут быть **"Рынок", "Секторы рынка", "Инструмент"** и **"Торговый счет"**.

По данным объектам фирме могут быть определены следующие права:

- на просмотр – "не определено", "видимо", "невидимо";
- на совершение операций – "не определено", "разрешено", "запрещено".

Установленные права показываются специальными символами в соответствующих столбцах окон **"View"** и **"Modif"**. Остальные столбцы для определения прав фирм не используются.

5.2. Пользователи

В торговой системе Биржи предусмотрены следующие типы пользователей:

- трейдер (брокер) относится к фирме;
- пользователь системы подтверждения – к организации;
- оператор (регистратор) – к Бирже;
- i-Клиент – физическое лицо.

Пользователь

Тип пользователя:

Трейдер Подтвержд. Брокер
 Оператор i-Клиент Регистратор

Фирма ID: AS004

Клиенты ASYL

Имя пользователя: AS004

Пароль установлен: Дней до изменения:

3 12 2009 -1747

Только SSL

Генерить ключи этому пользователю

Срок истечения сертификата:

Уст. собств. лимитов

Модуль обмена

Зарегистрирован Регистратор

0 : 0

Способы подключения

Терминал STrade Библ. доступ
 FIX MTrade

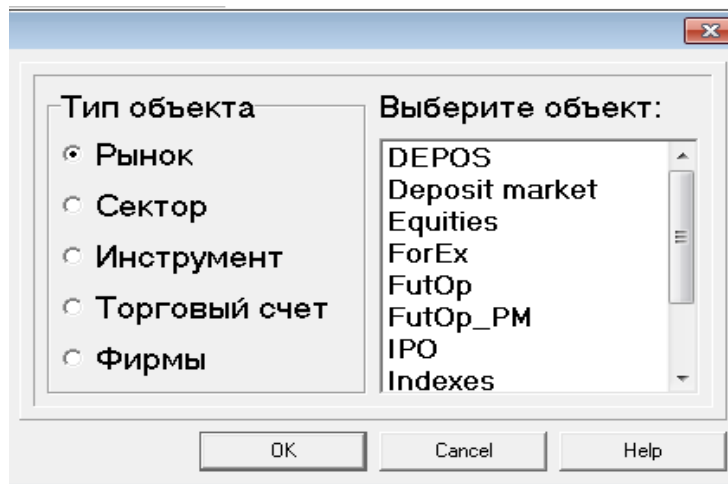
OK Cancel Help

Права пользователя можно просмотреть нажатием клавиш **Alt+1** или выбором соответствующей функции меню в окне **"Пользователи"** на выбранном пользователе.

Права: 5: AS004

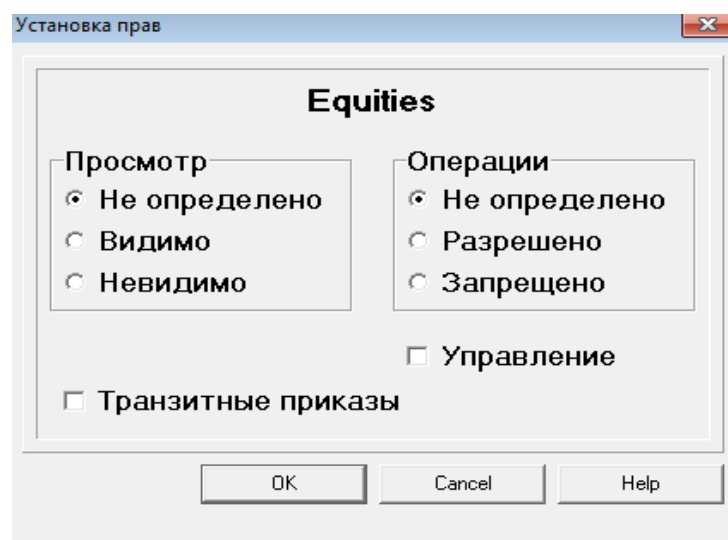
№ /	Объект	View	Modf	Close	Mngr	Tran	Apnd
1	M> Equities	Y	Y	-	+	+	-
2	M> ForEx	Y	Y	-	+		-
3	M> Indexes	Y	Y	-			-
4	M> Repo	Y	Y	-	+	+	-
5	M> TBills	Y	Y	-	+	+	-

В окне **"Права пользователя"** оператор может редактировать существующие права, добавлять новые или удалять некоторые, путем выбора соответствующих функций из меню и клавиш **Alt+Enter**, **Insert**, **Delete**.



Объектом прав для пользователя могут быть **"Рынок"**, **"Секторы рынка"**, **"Инструмент"**, **"Торговый счет"**, **"Фирмы"**. По данным объектам пользователю могут быть определены следующие права:

- на просмотр – "не определено", "видимо", "невидимо";
- на совершение операций – "не определено", "разрешено", "запрещено";
- управление – при включенной опции пользователь может управлять заявками других пользователей данной фирмы (просматривать, удалять);
- транзитные приказы – при включенной опции пользователь может формировать транзитные приказы брокеру (фирме, выступающей в качестве брокера);
- только добавление – может быть определено, как право операторов добавлять объект.



Для операторов может быть установлен специальный тип прав: "на все объекты".

Установленные права показываются специальными символами в соответствующих столбцах окна: **"View"**, **"Modif"**, **"Mngr"**, **"Tran"**, **"Apnd"**.

При установлении возможности подачи транзитных приказов, пользователю необходимо также предоставить права на объекты **"Фирма"** (фирмы, которые будут использоваться в роли брокера).

6.1. Описание предупреждений ввода новой заявки

На стадии ввода в форму подачи заявки цена проверяется автоматически, и в случае её отклонения от установленных лимитов в ту или иную сторону выдается предупреждение. Тексты предупреждающих и запрещающих сообщений вынесены в форму подачи заявки и имеют три строки.

В верхней строке жирным шрифтом отображается заголовок предупреждения, далее следует краткое его содержание с указанием кода предупреждения. В нижней строчке указывается рекомендуемый коридор цен с минимальным и максимальным значениями, в пределах которого можно подать заявку. Данная строка служит подсказкой пользователю, в каком диапазоне цен можно подать заявку без каких-либо отклонений от установленных лимитов.

Предупреждения о "преодолимых лимитах"¹¹ отображаются зеленым цветом и могут быть проигнорированы пользователем.

Предупреждения о "непреодолимых лимитах"¹² отображаются красным цветом и не могут быть проигнорированы пользователем.

¹¹ "Преодолимый лимит" – лимит отклонения цены, действие которого не запрещает подачу заявки с указанными параметрами и служит в качестве предупреждения.

¹² "Непреодолимый лимит" – лимит отклонения цены, действие которого запрещает подачу заявки с указанными параметрами.

Описание предупреждений

В настоящее время в торговой системе используются следующие предупреждения.

1. Предупреждения при превышении "преодолимых лимитов":

- **"Отклонение цены от лучшей цены покупки более чем на 5 %" –** выдается при условии, что имеется как минимум одна котировка на покупку, и рассчитывается от лучшей цены покупки;
- **"Отклонение цены от лучшей цены продажи более чем на 5 %" –** выдается при условии, что имеется как минимум одна котировка на продажу, и рассчитывается от лучшей цены продажи;
- **"Отклонение цены от последнего значения средневзвешенной цены более чем на 5 %" –** выдается при условии наличия средневзвешенной цены по инструменту и рассчитывается от последнего значения средневзвешенной цены;
- **"Отклонение цены от цены последней сделки более чем на 30 %" –** выдается при отклонении цены от цены последней сделки более чем на 30 % и рассчитывается от цены последней заключенной сделки;
- **"Превышен собственный преодолимый лимит более чем на ...%" –** выдается при отклонении цены от собственного преодолимого лимита на установленную величину в процентах. Данный лимит выставляется пользователем самостоятельно на денежном счете (при наличии соответствующих прав) и рассчитывается от последней цены предыдущего дня.

2. Предупреждения при превышении цены заявки "непреодолимых лимитов":

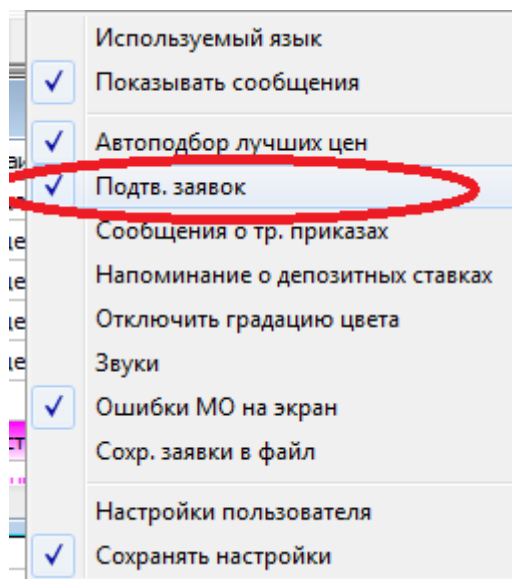
- **"Превышен непреодолимый лимит от последнего значения средневзвешенной цены более чем на 0,5 %" –** выдается при отклонении цены от лимита отклонения последнего значения

средневзвешенной цены более чем на 0,5 % и рассчитывается от последнего значения средневзвешенной цены;

- **"Превышен собственный непреодолимый лимит более чем на ...%"** – выдается при отклонении цены от собственного непреодолимого лимита на установленную величину в процентах. Клавиша "Купить/Продать" блокируется (при условии отключения опции "Подтв. заявок"). Данный лимит выставляется пользователем самостоятельно на денежном счете (при наличии соответствующих прав) и рассчитывается от последней цены предыдущего дня.

Подтверждение заявок

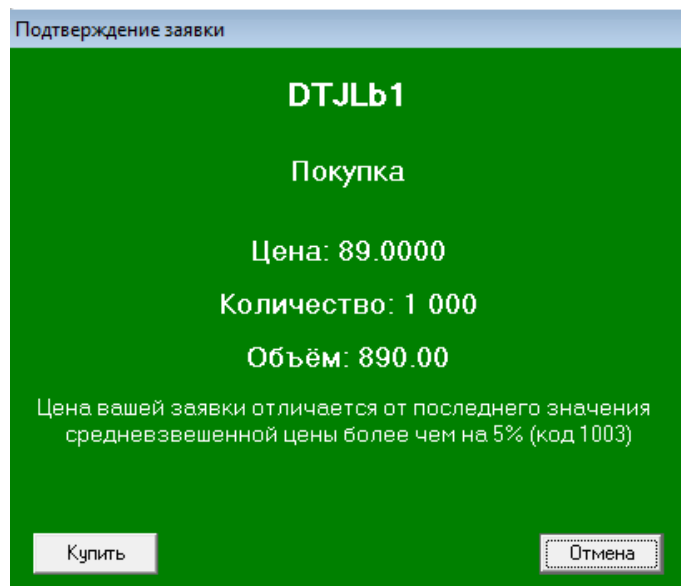
В целях подтверждения введенных данных в форму заявки добавлена дополнительная проверка в виде окна подтверждения. Опция по выводу окна подтверждения на экран включена по умолчанию; отключить эту опцию можно через панель управления: **"Настройки"** → **"Подтв. заявок"**.



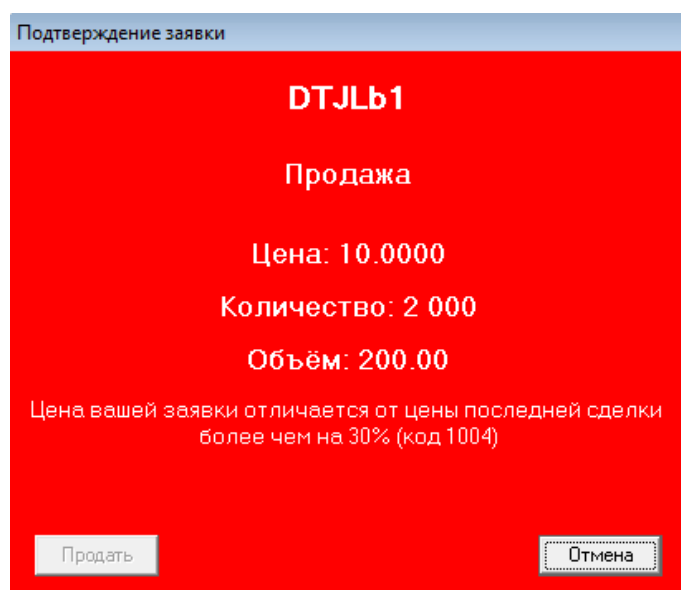
Окно подтверждения содержит информацию о:

- выбранном инструменте;
- направлении заявки;
- цене, указанной в заявке;
- количестве инструмента, указанном в заявке;
- объеме заявки;
- отклонении и преодолении лимитов, включая код предупреждения.

Фон окна подтверждения при покупке окрашен в зеленый цвет.



Фон окна подтверждения при продаже окрашен в красный цвет.



При превышении "непреодолимого лимита", выдается полное описание предупреждения, а клавиша "Купить/Продать" блокируется. Подать заявку с такими параметрами нельзя.

Предупреждение! В случае если вводимая цена превышает "непреодолимые лимиты", а опция "Подтв. заявок" выключена, то кнопка "Купить/Продать" блокируется уже в форме ввода заявки. Окно подтверждения в этом случае не выводится.

6.2. Метод открытых торгов

Для торговли методом открытых торгов в свойствах инструмента должна быть включена опция **"Лимитированные"** (разрешены лимитированные заявки).

Открытие торгов по инструменту осуществляется по расписанию или оператором в окне **"Сектор рынка"** или **"Финансовые инструменты"** путем выбора функции **"Открыть торги"**. После открытия торгов трейдер имеет право подавать лимитированные и рыночные заявки.

При вводе лимитированной заявки трейдер может указать время истечения заявки, по достижении которого заявка будет автоматически снята.

По инструментам с включенной опцией **"Есть доходность"** доходность рассчитывается автоматически.

В окне котировок представлена ранжированная по ценам очередь неудовлетворенных заявок, сведенных по ценам.

№	Продажа	Цена	Покупка	Ист. объём
1	1 000	127.0000...		1 000
2	13 000 000	126.3359...		13 000 000
3	2 000	125.0000...		2 000
4		118.0000...	12 999 000	12 999 000
5		117.0000...	1 000	1 000

При подаче новой лимитированной заявки она проверяется на наличие встречных заявок, и в случае наличия таковых заключение сделки осуществляется в соответствии с алгоритмом, приведенным в описании метода открытых торгов в [Приложении 1 "Краткое описание методов торгов"](#).

В свойствах инструмента может быть включена опция **"Рыночные"** (разрешены рыночные заявки). Удовлетворение рыночной заявки осуществляется по ценам встречных заявок до полного удовлетворения объема заявки. В случае если котировки встречного направления отсутствуют, заявка снимается с торгов.

При подаче рыночной заявки трейдер может выбрать опцию **"Только весь объем"**. Данная заявка должна быть удовлетворена в полном объеме по одной или нескольким ценам. В случае если весь объем заявки не удовлетворяется, сделка не заключается и заявка автоматически снимается с торгов.

Выбор опции **"По одной цене"** означает, что сделка может быть заключена только по одной цене и если весь объем заявки не может быть удовлетворен по одной цене, остаток заявки преобразуется в лимитированную заявку цене, соответствующей наилучшей встречной, существовавшей при подаче заявки и заключении сделки. Остаток не будет преобразовываться в лимитированную заявку, если трейдер выберет опцию **"Снять остаток"**.

В поле «Количество» при торговле Паями устанавливается значение домноженное на делитель. Т.е для покупки 1 пая, в поле «Количество» указывается значение 1 000 000, (если в параметрах инструменте делитель = 1 000 000)

6.3. Метод прямых торгов

Для возможности заключения прямых сделок по инструменту в свойствах инструмента должна быть включена опция **"Прямые"** (разрешены прямые сделки). В этом случае трейдер может подать прямую заявку необходимому контрагенту. Прямая заявка может быть подана нажатием кнопки **"Direct"** в строке управления или выбором соответствующей функции в меню или через окно **"Финансовые инструменты"** нажатием "горячих" клавиш **Ctrl+2**

Ввод новой заявки

ККГBe15

Направл.: Пок. Прод.

Цена: _____

Доходность, %: 0.0000

Контрагент: _____

Количество: _____

Торговый счет: _____

Объем: 0.00

Дата расч.: ____ . ____ . ____

Расчеты: Депозитарий Регистратор

OK Cancel Help

При подаче прямой заявки указывается контрагент, место расчетов (Центральный депозитарий или регистратор) и дата расчетов (допускается T+n).

Прямые заявки также могут быть поданы при просмотре окна **"Прямые котировки"**. В данном окне по выбранной индикативной котировке для подачи прямой заявки контрагенту, подавшему индикативную котировку, можно использовать функции **"Заявка на покупку"** (**Ctrl+1**), **"Заявка на продажу"** (**Ctrl+2**). В этом случае параметры подаваемой прямой заявки формируются в соответствии с параметрами индикативной котировки.

Поданная прямая заявка находится в окне **"Заявки"** и может быть удовлетворена контрагентом при выборе соответствующих функций. При удовлетворении прямой заявки контрагент должен продублировать параметры поданной заявки.

Подачу собственных индикативных котировок по инструментам сектора рынка можно осуществить, нажав клавиши **Ctrl+W** или выбрав соответствующую функцию меню **"Просмотр"**.

Прямые котировки: 5: KZT030D					
№	Контрагент	Спрос	Предложе...	Покупка	Продажа
1	Avg/Total	3.50	5.50	450 000 000	450 000 000
2	The Best	3.50	5.50	450 000 000	450 000 000
3	EURAS	3.50	5.50	150 000 000	150 000 000
4	ККВ__	3.50	5.50	150 000 000	150 000 000
5	MERCH	3.50	5.50	150 000 000	150 000 000

6.4. Метод специализированных торгов

Объявляется время периода приема заявок. В этот период времени торги по инструменту открыты в режиме **"Размещение"** (соответствующая функция

выбрана маклером в меню инструмента). Под режимом **"Размещение"** подразумевается проведение торгов по размещению или выкупу ценных бумаг в зависимости от объявленных условий.

В период приема заявок участники подают заявки только одного направления (на покупку или продажу в зависимости от объявленных условий размещения или выкупа).

Участники могут подавать лимитированные и рыночные заявки. В процессе проведения торгов в зависимости от объявленных условий они могут видеть собственные заявки и котировки других участников торгов.

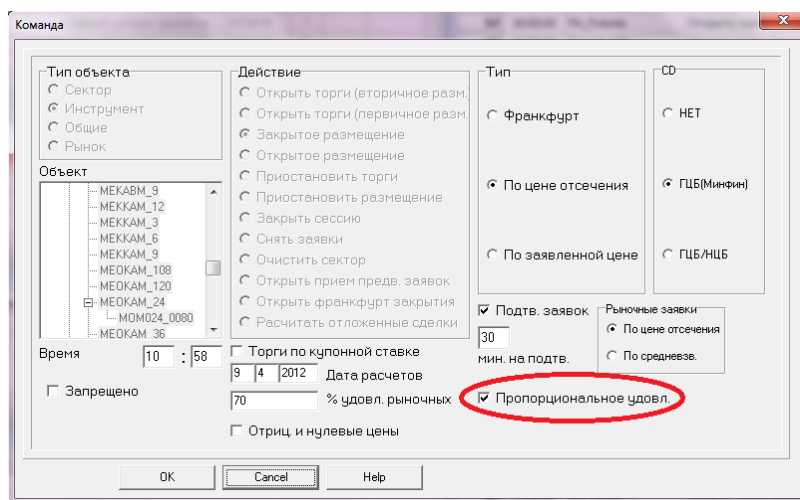
По окончании периода приема заявок торги приостанавливаются (не закрываются!), производится оформление сводной ведомости, передаваемая продавцу (покупателю), который определяет цену отсечения и объем размещения или выкупа.

После приостановления торгов участники не имеют возможности аннулировать собственные заявки.

Заключение сделок по определенной цене отсечения осуществляется оператором в торговой системе Биржи или отдельным бэк-офисным программным обеспечением Биржи в соответствии с процедурой удовлетворения заявок, приведенной в описании метода в [Приложении 1 "Краткое описание методов торгов"](#).

6.4.1. Проведение специализированных торгов с пропорциональным удовлетворением

При выборе опции "Пропорциональное удовлетворение" в свойствах команды расписания "Закрытое размещение" оператором могут быть указаны доли удовлетворения рыночных заявок, а объем размещения распределяться пропорционально поданным заявкам.



В случае если по цене отсечения полное удовлетворение всех заявок не представляется возможным в виду их превышения объема удовлетворения, они удовлетворяются пропорционально их размерам в пределах, допускаемых долей удовлетворения рыночных заявок.

В случае если цена заявок лучше цены отсечения, и имеется возможность полного удовлетворения всех заявок с лучшей ценой, то удовлетворяется все их количество.

6.5. Метод франкфуртских торгов

Использование метода франкфуртских торгов возможно двумя способами: предотвращение манипуляций ценами и торги при размещении или выкупе ценных бумаг и иных инструментов.

С целью информирования трейдеров о возможном переводе торгов в режим ожидания¹³ в случае исполнения заявки, в форму подачи заявки добавлено соответствующее сообщение.

В случае наличия встречных заявок и отклонения заявленной цены от цены последней сделки с данными акциями на определенную величину (5 % – по ликвидным акциям, 10 % – по неликвидным) появится предупреждение – **"Режим ожидания (франкфуртский аукцион)"**, которое означает, что при подаче заявки с указанными параметрами торги будут переведены на метод их проведения методом франкфуртских торгов. В скобках указывается минимальная (**min**) либо максимальная (**max**) цена в зависимости от цены встречной заявки, при вводе которой эта сделка будет заключена без использования метода франкфуртских торгов.

6.5.1. Предотвращение манипуляций ценами (режим ожидания)

Если в свойствах сектора инструмента включена опция **"Режим ожидания"** и указано время ожидания **"Мин. ожидания"** (период приема заявок), то при попытке заключить сделку при проведении торгов методом открытых торгов торговая система Биржи автоматически переводит торги в режим ожидания, в случаях:

- отклонения цены возможной сделки от цены последней сделки на величину, установленную нормативными документами Биржи;
- проведения аукциона закрытия.

¹³ По неликвидным акциям планируется переводить торги в режим ожидания только в случае отклонения возможной цены сделки с какими-либо акциями от цены последней сделки с данными акциями более чем на 5 %.

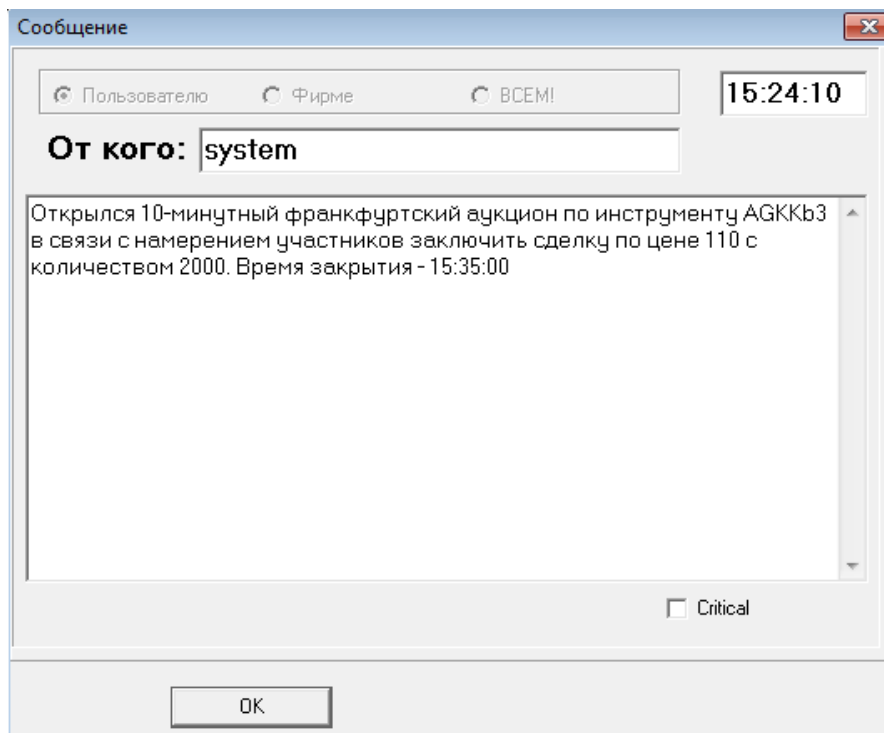
По ликвидным акциям торги планируется переводить в режим ожидания только в случае отклонения возможной цены сделки с какими-либо акциями от цены последней сделки с данными акциями более чем на 10 %.

После введения указанных изменений работы режима ожидания участники торгов будут вправе удалять заявки, поданные ими до начала режима ожидания.

В режиме ожидания торги проводятся методом франкфуртских торгов.

Торги проводятся методом франкфуртских торгов на время, указанное в опции (период приема заявок).

Все участники торгов оповещаются об этом, например:



В объявленный период времени все желающие могут подавать только лимитированные заявки. Во время проведения режима ожидания участники могут аннулировать свои заявки, которые были поданы как до, так и после его начала.

Окно **"Котировки"** в период приема заявок предоставляет информацию о суммарном количестве инструмента, которое участники хотят купить или продать по соответствующей цене, то есть столбцы "Продажа" и "Покупка" представлены нарастающим количеством инструмента по каждой цене.

№	Продажа	Цена	Покупка	Ист. объём
1	120 000	65.00		40 000
2	80 000	59.00	40 000	80 000
3	40 000	55.00	80 000	80 000
4		50.00	140 000	60 000

По данным окна **"Котировки"** пользователи могут определить цену или цены, по которым возможно заключение максимального объема сделок.

Например, на рисунке имеются две возможных цены – 55 и 59, по которым возможно заключение сделок на суммарное количество 40 000. В этом случае, если бы заявки не изменились на момент закрытия периода приема заявок, торговая система Биржи автоматически определила бы цену отсечения равная 57, как арифметическое среднее между возможными ценами. Необходимо отметить, что в данном примере, удовлетворяются все заявки на покупку, поданные по цене выше цены отсечения и равной ей.

Период приема заявок продолжается не менее времени, установленного параметром сектора **"Мин. ожидания"**, и заканчивается по истечении времени, установленного параметром сектора **"Доп. ожидания"**, с момента подачи новой или аннулирования любой заявки. Время окончания режима ожидания, скорректированное таким образом, отображается в заголовке окна **"Котировки"** (кроме аукциона закрытия).

Для удобства ввод новой заявки и аннулирование заявки, поданной в течение режима ожидания, выделяется в строке финансовых инструментов жирным шрифтом в течение нескольких секунд.

По окончании периода приема заявок торговая система Биржи автоматически определяет цену отсечения в соответствии с алгоритмом, изложенным в описании метода в [Приложении 1 "Краткое описание методов торгов"](#).

После определения цены отсечения и заключения сделок методом франкфуртских торгов торговля по инструменту продолжается методом открытых торгов (кроме аукциона закрытия), при этом осуществляется переформирование информации в окне **"Котировки"** для дальнейшего использования метода открытых торгов.

6.5.2. Проведение франкфуртских торгов при размещении или выкупе

При открытии торгов в режиме **"Размещение"** участники торгов подают только лимитированные заявки на время приема заявок.

В период приема заявок трейдеры, в отличие от случаев применения метода франкфуртских торгов в "Режиме ожидания", могут видеть только собственные заявки (аннулирование которых допускается). Окно **"Котировки"** не предоставляет информацию о заявках, поданных другими участниками.

В момент закрытия периода приема заявок определение цены отсечения и заключение сделок производятся торговой системой Биржи автоматически в соответствии с алгоритмом, изложенным в описании метода в [Приложении 1 "Краткое описание методов торгов"](#).

6.6. Метод фиксинга

Путем выбора функции **"Открыть предв. фиксинг"** в окне **"Финансовые инструменты"** оператор открывает период приема предварительных заявок по выбранному инструменту.

В период приема предварительных заявок все заявки от участников торгов принимаются по стартовой цене, определенной в свойствах инструмента как цена открытия.

По каждому торговому счету может быть сформировано только две предварительных заявки: одна на покупку и одна на продажу. Если по торговому счету было подано несколько предварительных заявок одного направления на покупку или продажу, они суммируются в одну заявку соответствующего направления.

До начала торгов методом фиксинга участники не имеют информации об общем объеме предварительного спроса и предложения. Открыть торги методом фиксинга оператор может, выбрав функцию **"Открыть фиксинг"**.

После открытия торгов в окне **"Котировки"** участники торгов могут видеть текущий курс, общий объем заявок выставленных на продажу (предложение) и на покупку (спрос), разницу между предложением и спросом, а также установленный шаг изменения цены.

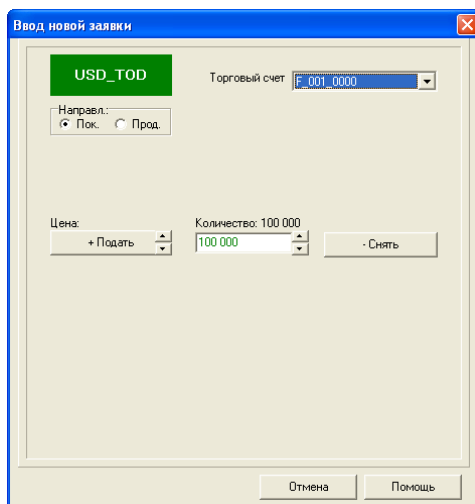


№	Продажа	Цена	Покупка	Ист. объём
1	1 200 000	0.0000	1 000 000	

Если разница между предложением и спросом положительная, то маклер может понизить курс на величину шага, если отрицательная – повысить его нажатием клавиши **F12** или соответствующей кнопки в строке управления.

Изменение курса отображается выделением строки инструмента соответствующим цветом в окне **"Финансовые инструменты"**.

Участники могут подавать дополнительные заявки по текущему курсу и только на сокращение разницы между предложением и спросом.



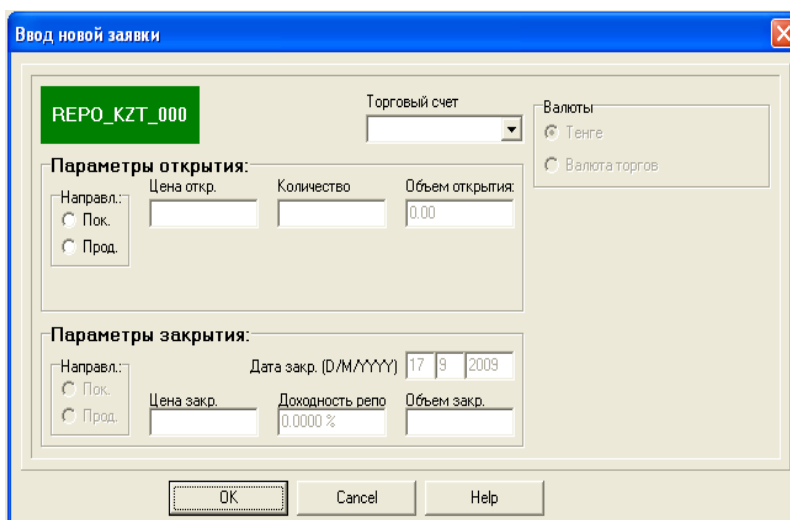
В окне **"Ввод дополнительной заявки"** предусмотрены две кнопки **"Подать"** и **"Снять"**, которые позволяют скорректировать текущие заявки участников торгов. **"Подать"** позволяет добавить количество инструмента к собственной заявке, **"Снять"** – уменьшить заявку участника на определенное количество.

Если дополнительная заявка подана на величину большую, чем разница, заявка принимается только в объеме разницы. В момент, когда разница становится нулевой, курс фиксируется, и все сделки заключаются по данному курсу.

Глава 7. Рынок репо

7.1. Прямое репо

Для заключения сделки "прямого" репо участники торгов используют метод заключения прямых сделок. При подаче прямых заявок указываются параметры сделки открытия и закрытия. Серым цветом помечены значения, которые не подлежат редактированию и высчитываются торговой системой автоматически.



- Ставка репо** – параметр операции репо, устанавливаемой участниками операции репо самостоятельно
- Доп.ур.риска** – выраженная в процентах величина допустимого отклонения рыночной цены предмета операции репо, согласованная участниками операции репо при осуществлении данной операции репо, по достижении которой наступает случай нижней или верхней

переоценки. Значение дополнительного уровня риска не может быть больше значения 99.99 и меньше значения 0

Цена откр.	–	параметр операции репо, высчитываемый торговой системой автоматический на основе ставки репо устанавливаемой участниками операции репо
Рыночная цена	–	цена ценных бумаг, принимаемая для расчетов, определяемая в соответствии с Методикой оценки ценных бумаг
Срок (дней)	–	измеряемый в днях промежутки времени между датами закрытия и открытия операции репо. Возможно, ввести как количество дней, так и указать дату закрытия операции репо
Ставка репо (факт.)	–	параметр операции репо, высчитываемый торговой системой автоматический на основе ставки репо устанавливаемой участниками операции репо

При заключении сделки "прямого" репо в торговой системе Биржи формируется репо-обязательство, которое в день проведения обратной операции (сделки закрытия) напоминает контрагентам о необходимости ее проведения.

7.2. Изменение параметров сделок закрытия репо

Изменение параметров сделки закрытия репо применяется только к сделкам "прямого" репо (поскольку на рынке "автоматического" репо контрагенты не знают друг друга) и осуществляется следующим образом.

В случае если для исполнения сделки закрытия, относящейся к операции репо, которая осуществляется "прямым" способом, используются торговые счета, контролируемые через систему подтверждения, то допускаемое внутренними документами биржи изменение параметров (даты или цены закрытия операции репо) данной сделки может быть осуществлено только при условии, что такое изменение подтверждено соответствующими участниками системы подтверждения.

При этом в окне **"Репо-обязательства"** сделка закрытия репо, которую при пролонгировании должен подтвердить пользователь системы подтверждения, отображается **зеленым** цветом.

№ /	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Счет списа...	Счет зачисле...	Прода...	Покупат...	Сост. пр...	Цена откр.	Дата откр.	Сделка от...	Сделка
16	10.09.20...	SKKZb3	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	11:36:21...	1 492 165	
17	10.09.20...	SKKZb3	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	11:36:02...	1 492 161	
18	14.09.20...	SKKZb1	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	15:31:13...	1 493 355	
19	14.09.20...	SKKZb1	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	15:30:53...	1 493 354	
20	14.09.20...	SKKZb1	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	15:30:09...	1 493 352	
21	14.09.20...	SKKZb1	955.4658	2 000 000 0...	1000000000	???	NBRK_	ALB_		950.0000	15:30:31...	1 493 353	
22	24.09.2009	R_ATFBe4_007	1 100.0000	1 000	1000000005	1000000007	NBRK_	NBRK_		1 100.0000	15:16:01...	1 496 336	
23	01.10.2009	BTAS	1 100.00	1	1000000022	1000000021	NBRK_	NBRK_	W	1 000.00	10:57:02...	1 496 335	
24	01.10.2009	R_ATFBe4_014	400.0000	100	1000000005	1000000002	NBRK_	NBRK_		400.0000	15:27:42...	1 496 337	

В столбцах **"Сост. прод."** ("Состояние продавца репо") и **"Сост. пок."** ("Состояние покупателя репо") символом **"W"** показывается ожидание подтверждения или отказа в подтверждении изменения параметров сделки закрытия репо со стороны соответствующих пользователей системы подтверждения.

Пользователи системы подтверждения могут ознакомиться с предполагаемым изменением параметров сделки закрытия репо, подведя курсор к строке, соответствующей данной сделке, и нажав правую клавишу мыши. В результате появится всплывающее окно, в котором необходимо выбрать строку **"Пролонгирование продавцом"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+6**) или **"Пролонгирование покупателем"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+7**).

№ /	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Цена откр.	Дата откр.	Сделка от...	Сделка за...	Продал	Сост. прод.
230	02.02.20...	R_GB_ENRC...	13.5000	11	13.5000	14:44:10 05.01.2010	1 545 652	0		0
231	02.02.20...	R_RDGZ__0...	12.0000	81	12.0000	12:57:25 05.01.2010	1 545 570	0		0
232	02.02.20...	R_RDGZ__0...	12.0000	72	12.0000	12:58:33 05.01.2010	1 545 574	0		0
233	02.02.20...	R_RDGZ__0...	12.0000	72	12.0000	12:58:06 05.01.2010	1 545 573	0		0
234	02.02.20...	R_RDGZ__0...	12.0000	82	12.0000	12:55:13 05.01.2010	1 545 568	0		0
235	05.02.2010	R_TSN__030	12.5000	19	12.5000	12:21:01 06.01.2010	1 545 941	0		0
236	18.02.2010	НСВК	323.55	62.500	305.75	12:44:50 25.11.2009	1 532 322	0		W
237	18.02.2010	Выполнить продажу			18 708.03	14:32:47 26.11.2009	1 532 951	0		0
238	18.02.2010	Выполнить покупку			21 939.61	12:46:41 25.11.2009	1 532 324	0		0
239	18.02.2010	Пролонгирование продавцом			181.20	12:43:57 25.11.2009	1 532 321	0		0
240	18.02.2010	Пролонгирование покупателем			865.00	15:17:22 25.11.2009	1 532 546	0		0
241	18.02.2010	Подтвердить пролонгацию продавца			5.00	15:05:07 26.11.2009	1 533 005	0		0
242	18.02.2010	Отклонить пролонгацию продавца			940.00	12:45:46 25.11.2009	1 532 323	0		0
243	25.03.2010	Добавить			1 028.3173	15:55:46 25.12.2009	1 542 845	0		0
244	06.04.2010	Удалить			644.00	14:44:33 06.01.2010	1 546 005	0		0
245	27.09.2010	Подсказка			1 500.00	11:52:10 20.09.2007	1 093 832	0		0

В результате этих действий появится всплывающее окно, содержащее сведения о предполагаемом изменении параметров сделки закрытия репо.

Пролонгация ✖

<p>Продавец:</p> <p>Дата закрытия</p> <p style="text-align: center;">15 10 2009</p> <p>Цена закрытия</p> <p style="text-align: center;">750.00</p>	<p>Покупатель:</p> <p>Дата закрытия</p> <p style="text-align: center;"> </p> <p>Цена закрытия</p> <p style="text-align: center;">0.00</p>
<input type="button" value="OK"/>	<input type="button" value="Cancel"/>

Чтобы подтвердить изменение параметров сделки закрытия репо или отказать в его подтверждении, необходимо подвести курсор к строке, соответствующей данной сделке, и нажать правую клавишу мыши. В результате появится всплывающее окно, содержащее две основные функции – **"Подтвердить пролонгацию покупателем"** (**"Подтвердить пролонгацию продавцом"**) и **"Отклонить пролонгацию покупателем"** (**"Отклонить пролонгацию продавцом"**).

№ /	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Сделка откр.	Сделка закр.	Продан	Сост. пр...	Продано	Купил	Сост. п...	Куплено
1	10.09.2009	CCBN	384.34	8 000	SEVEN	SEVEN	375.00	1 468 546	0			00:00:00...			00:00:00...
2	28.09.2009	GB_KZMS	2 078.86	2 672	SEVEN	SEVEN	2 052.00	1 490 439	0			00:00:00...			00:00:00...
3	01.12.2009	НСВКр1	210.00	1 000	КВВАМ	КВВАМ	200.00	1 503 549	0	W		00:00:00...	W		00:00:00...
4	06.12.2009	GB_ENRC	1 290.07	16 000	КВВАМ	IFG_						00:00:00...			00:00:00...

№ /	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Сделка откр.	Сделка закр.	Продал	Сост. пр...	Продано	Купил	Сост. п...	Куплено
1	10.09.2009	CCBN	384.34	8 000	SEVEN	SEVEN	375.00	1 468 546	0			00:00:00...			00:00:00...
2	28.09.2009	GB_KZMS	2 078.86	2 672	SEVEN	SEVEN	2 052.00	1 490 439	0			00:00:00...			00:00:00...
3	01.12.2009	HSBKp1	210.00	1 000	KIBAM	KIBAM	200.00	1 503 549	0		W	00:00:00...		W	00:00:00...
4	06.12.2009	GB_ENRC	1 290.07	16 000	KIBAM	IFG...						00:00:00...			00:00:00...

Для того чтобы подтвердить изменение параметров сделки закрытия репо, следует выбрать функцию **"Подтвердить пролонгацию покупателем"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+8**) или **"Подтвердить пролонгацию продавцом"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+9**).

Для того чтобы отказать в подтверждении изменения параметров сделки закрытия репо, следует выбрать функцию **"Отклонить пролонгацию покупателем"** или **"Отклонить пролонгацию продавцом"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+0**).

Если пользователь системы подтверждения подтвердил изменение параметров сделки закрытия репо, то цвет строки, соответствующей данной сделке, изменится на **черный**, а ее параметры репо будут изменены.

Если пользователь системы подтверждения отказал в подтверждении изменения параметров сделки закрытия репо, то цвет строки, соответствующей данной сделке, также изменится на **черный**, но ее параметры при этом изменены не будут.

№	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Цена откр.	Дата откр.	Сделка от...	Сделка за...	Продал	Сост. пр...	Продано	Купил	Сост. п...	Куплено	Обт...
25	01.12.2009	RDGZ	1 205.00	1 000	1 200.00	11:37:36...	1 496 338	0		W	00:00:00...			00:00:00...	
5	08.09.20...	SKKZb5	955.4658	2 000 000 0...	950.0000	11:49:00...	1 491 038	0			00:00:00...			00:00:00...	
6	08.09.20...	SKKZb5	955.4658	2 000 000 0...	950.0000	11:48:45...	1 491 037	0			00:00:00...			00:00:00...	
7	08.09.20...	SKKZb5	955.4658	2 000 000 0...	950.0000	11:48:29...	1 491 036	0			00:00:00...			00:00:00...	
8	09.09.20...	SKKZb10	955.4658	2 000 000 0...	950.0000	14:50:37...	1 491 790	0			00:00:00...			00:00:00...	
9	09.09.20...	SKKZb10	955.4658	2 000 000 0...	950.0000	14:49:45...	1 491 789	0			00:00:00...			00:00:00...	

7.2.1. Переоценка обязательств

В целях снижения риска неисполнения участниками операции репо своих обязательств по сделке закрытия участники операции репо, в случае наступления условий переоценки объекта операции репо, осуществляют нижнюю¹⁴ либо верхнюю переоценку¹⁵ обязательств по соответствующей операции репо. Случай нижней или верхней переоценки наступает, если в течение срока репо у участника операции репо значение модуля дефицита компенсационного платежа¹⁶ достигает или становится больше значения допустимого уровня риска¹⁷, установленного участниками для данной операции репо. При этом если значение дефицита

¹⁴ "Нижняя переоценка" – событие, в результате которого покупатель репо в случае уменьшения рыночной цены предмета операции репо ниже установленного уровня имеет право произвести переоценку обязательств по сделке закрытия репо. Нижняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения продавцом репо своих обязательств по сделке закрытия.

¹⁵ "Верхняя переоценка" – событие, в результате которого продавец репо в случае увеличения рыночной цены предмета операции репо выше установленного уровня имеет право произвести переоценку обязательств по сделке закрытия репо. Верхняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения покупателем репо своих обязательств по сделке закрытия.

¹⁶ "Модуль дефицита компенсационного платежа" – положительная величина, соответствующая абсолютному значению (модулю) дефицита компенсационного платежа..

¹⁷ "Допустимый уровень риска" – выраженная в процентах величина допустимого отклонения рыночной цены предмета операции репо, согласованная участниками операции репо при осуществлении данной операции репо, по достижении которой наступает случай нижней или верхней переоценки.

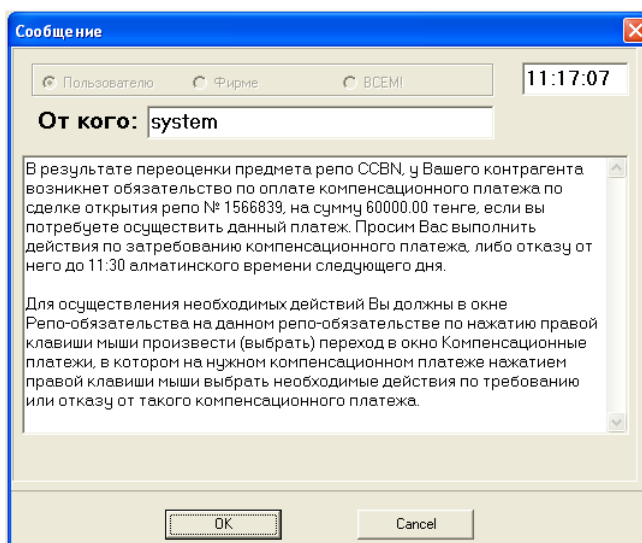
компенсационного платежа¹⁸ отрицательно, то наступает случай нижней переоценки, если положительно – наступает случай верхней переоценки.

В случае изменения рыночной цены осуществляется переоценка обязательств участников операции репо, в результате которой при превышении допустимого уровня риска, установленного контрагентами для данной операции репо, и в зависимости от верхней или нижней переоценки, возникает требование по компенсационному платежу у покупателя либо продавца репо.

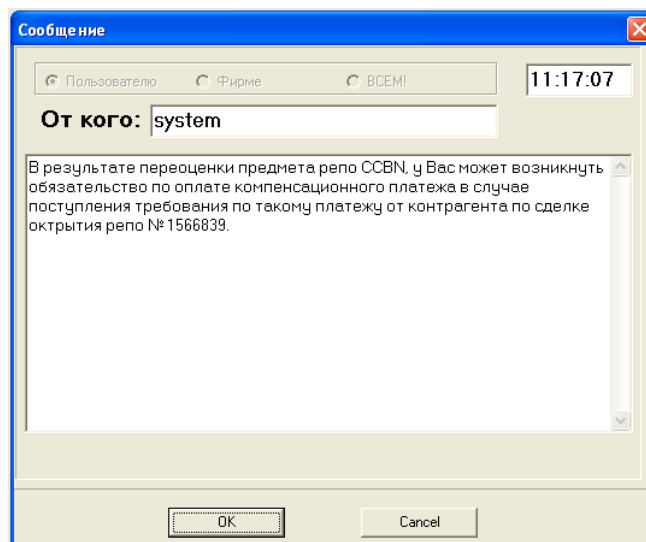
Факт наступления случая верхней переоценки определяется торговой системой автоматически, о чем покупатель и продавец репо незамедлительно оповещаются посредством получения соответствующего уведомления (сообщения) в торговой системе.

В данном случае у участников операции репо на экране терминала торговой системы появится сообщение следующего характера:

- сообщение для продавца репо



- сообщение для покупателя репо



При этом у участника торгов, от которого требуется произвести какое-либо действие, запись в окне **"Репо обязательства"** приобретает **красный** цвет.

¹⁸ "Дефицит компенсационного платежа" – выраженная в процентах величина, отражающая соотношение текущей рыночной стоимости предмета операции репо на определенную дату с учетом коэффициента обеспечения и суммы сделки открытия и перечисленных участниками данной операции репо компенсационных платежей на эту же дату.

Репо обязательства: 1

№	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Сделка откр.	Сделка закр.
1	13.04.2010	ССВН	950.26	1 000	NBRK_	TURAL	950.00	1 566 839	0

Одновременно у участника торгов, который ожидает действий со стороны своего контрагента, запись в окне подсвечена **светло-зеленым** цветом.

Репо обязательства: 1

№	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Сделка откр.	Сделка закр.
1	13.04.2010	ССВН	950.26	1 000	NBRK_	TURAL	950.00	1 566 839	0

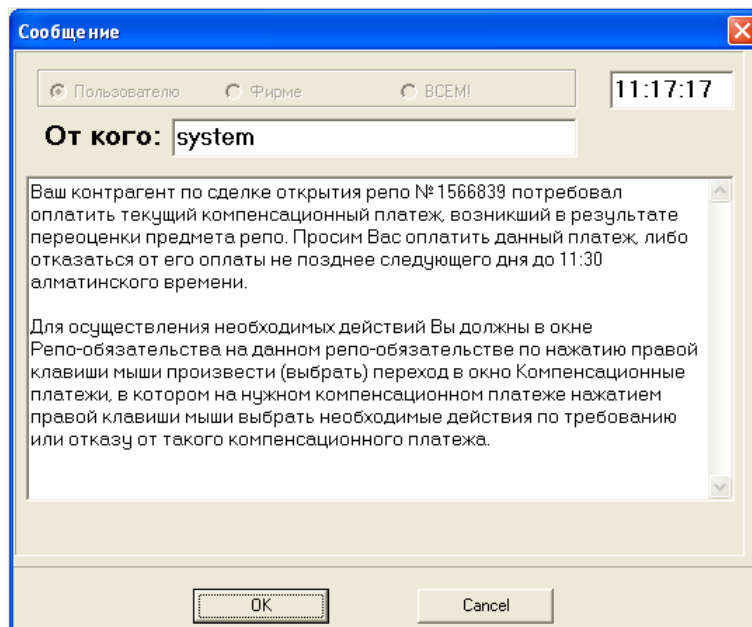
При наступлении случая **верхней переоценки** продавец репо имеет право через окно **"Компенсационные платежи"** направить покупателю репо требование о перечислении компенсационного платежа, выбрав опцию "Требовать КП" ("горячая" клавиша – **Ctrl+1**).

Компенсационные платежи: 1: 1 566 839

№	Дата	Переоценка (%)	Текущая рыночная цена	Сост.	Об-во покупателя по КП	Об-во продавца по КП
1	12.04.2010	1.0526	960.0000	Waits for User	10 000.00	0.00

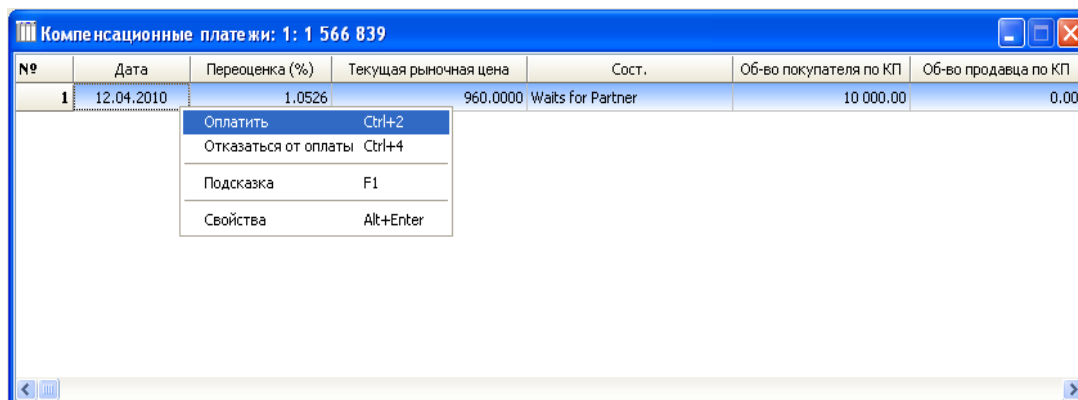
Требовать КП Ctrl+1
 Не Требовать КП Ctrl+5
 Подсказка F1
 Свойства Alt+Enter

Вслед за этим контрагент будет уведомлен о необходимости оплаты компенсационного платежа посредством соответствующего сообщения;



Внимание! Участник операции репо, которому было направлено требование о перечислении компенсационного платежа, должен перечислить сумму компенсационного платежа после получения такого требования не позднее следующего дня 11:30 алматинского времени.

При наступлении случая **нижней переоценки** покупатель репо имеет право направить продавцу репо требование о перечислении компенсационного платежа, выбрав опцию "Оплатить" ("горячая" клавиша – **Ctrl+2**).



Если участник операции репо, которому было выставлено требование о перечислении компенсационного платежа, ранее сам получал компенсационные платежи по этой операции репо от другого участника, то перечисляемая им в соответствии с данным требованием сумма компенсационного платежа включает в себя:

- 1) возврат второму участнику операции репо полученных от него и не возвращенных ему ранее компенсационных платежей (в размере, не превышающем суммы компенсационного платежа);
- 2) собственно компенсационный платеж участника операции репо (в размере разницы между суммой компенсационного платежа и суммой полученных от второго участника операции репо и не возвращенных ему ранее компенсационных платежей).

В случае если для исполнения сделок открытия и закрытия операции репо должны быть использованы торговые счета, контролируемые через систему подтверждения, то перечисления компенсационных платежей производятся только после получения сообщений об их подтверждении через систему подтверждения.

№	Дата	Переоценка (%)	Текущая рыночная цена	Сост.	Об-во покупателя по КП	Об-во продавца по КП
1	12.04.2010	1.0526	960.0000	Waits for Partner	10 000.00	0.00

Подтвердить оплату Ctrl+3

Отказаться от оплаты Ctrl+4

Подсказка F1

Свойства Alt+Enter

В случае успешной оплаты компенсационного платежа состояние записи о компенсационном платеже в окне "Компенсационные платежи" меняется на – **"Paid"**. При этом само репо-обязательство в окне "Репо обязательства" приобретает стандартный цвет.

№	Дата закр.	Инструмент	Цена закр.	Количество	Продавец	Покупатель	Цена откр.	Сделка откр.	Сделка закр.
1	13.04.2010	CCBN	950.26	1 000	NBRK_	TURAL	950.00	1 566 839	0

Примечание Датой получения участником операции репо требования о перечислении компенсационного платежа считается дата регистрации указанного требования в торговой системе Биржи.

В случае если при наступлении нижней или верхней переоценки, покупатель/продавец репо отказывается направить контрагенту требование о перечислении компенсационного платежа, в окне **"Компенсационные платежи"** нужно выбрать запись, соответствующую данной операции **"Не требовать КП"**. В этом случае в столбце "Состояние" соответствующей записи проставляется статус - **"Not need"**, и обязательства по оплате компенсационного платежа у контрагента не возникает.

№	Дата	Переоценка (%)	Текущая рыночная цена	Сост.	Об-во покупателя по КП	Об-во продавца по КП
1	12.04.2010	1.0526	960.0000	Waits for User	10 000.00	0.00

Требовать КП Ctrl+1

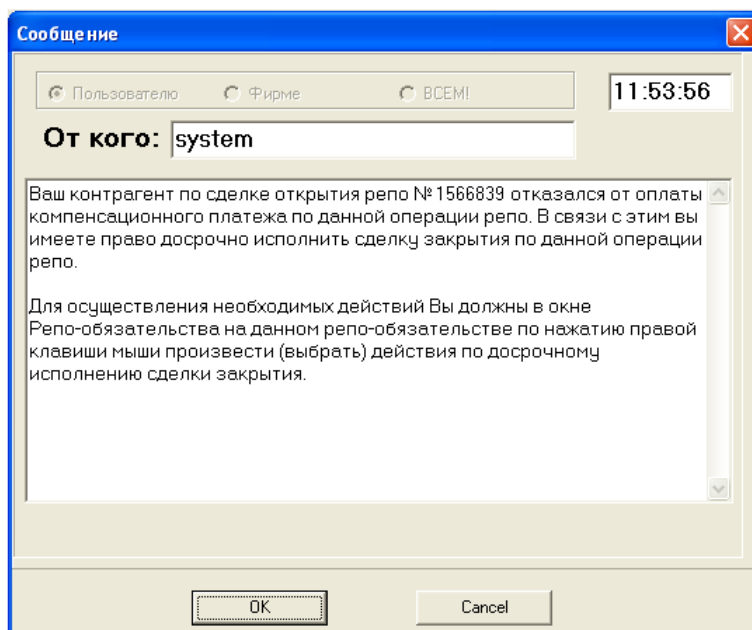
Не Требовать КП Ctrl+5

Подсказка F1

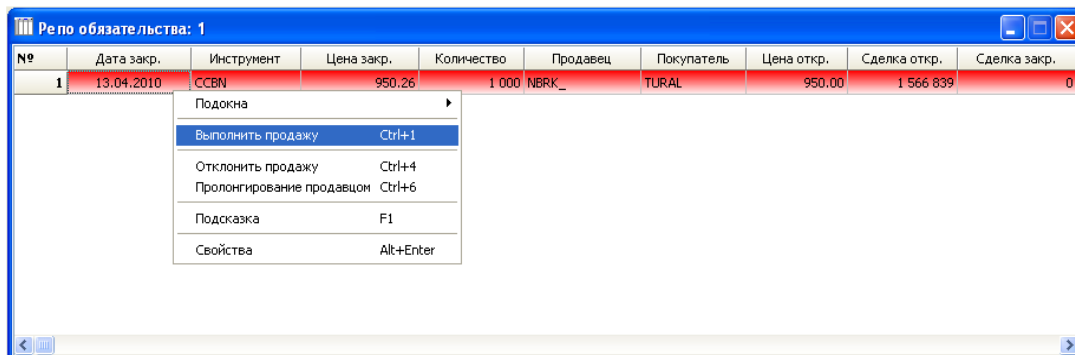
Свойства Alt+Enter

Неисполнение обязательств по оплате компенсационного платежа

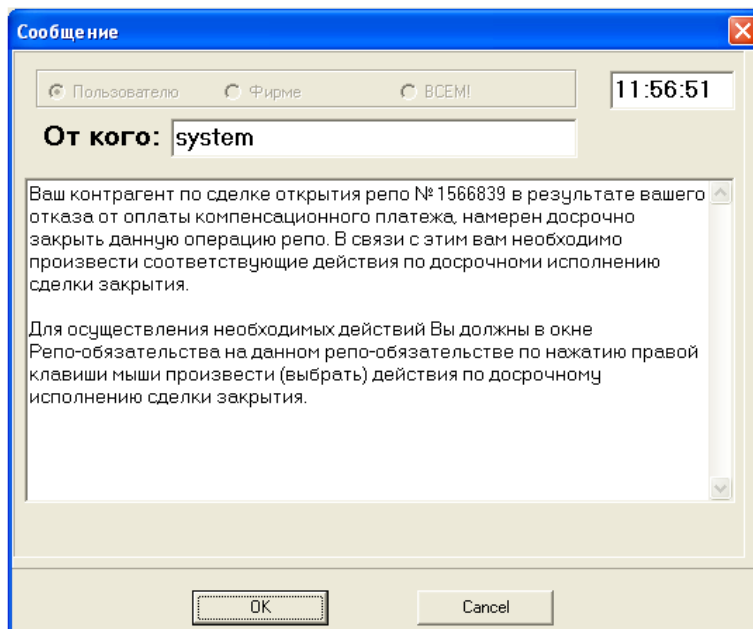
В случае нарушения соглашения, вызванного неисполнением или ненадлежащим исполнением кем-либо из участников операции репо своих обязательств по перечислению компенсационного платежа, пострадавший участник имеет право в одностороннем порядке потребовать досрочного исполнения сделки закрытия по данной операции репо. Наравне с этим, если на следующий день за днем возникновения платежа, в окне **"Компенсационные платежи"** имеются затребованные, но не оплаченные компенсационные платежи со статусом **"Waits for Partner"** и/или **"Waits for Confirm"**, торговая система автоматически переводит их в статус **"Rejected by User"**. После чего контрагенту приходит сообщение о том, что он может досрочно закрыть данное репо обязательство.



Участник сделки репо, получивший данное сообщение, имеет возможность закрыть его досрочно. При этом цена закрытия операции репо будет пересчитана торговой системой автоматически.



Вторая сторона операции репо получает соответствующее сообщение о намерении контрагента досрочно закрыть данную сделку репо.



Примечание В случае аннулирования сделки закрытия, в соответствии с Правилами осуществления операции репо, участники операции репо освобождаются от обязательств по возврату компенсационных платежей, уплаченных ими по операции репо, к которой относится данная сделка закрытия и процентов по ним.

Закрывтие сделки операции репо

При закрытии репо-обязательства в установленный срок сумма компенсационных платежей и накопленных процентов по ним суммируется у покупателя и продавца, далее происходит их взаимозачет. Положительная разница прибавляется к общей сумме закрытия данного репо обязательства.

Участник репо, получивший компенсационный платеж, обязан уплатить участнику репо, перечислившему данный компенсационный платеж, проценты на сумму компенсационного платежа по ставке репо за период с даты получения компенсационного платежа (в расчет периода не включается) до даты его возврата включительно.

7.3. "Автоматическое" репо

Рынок "автоматического" репо позволяет размещать и привлекать деньги под обеспечение ценных бумаг (объектов репо) путем заключения сделок репо, стандартизированных по сроку, методом открытых торгов.

В качестве основного торгового параметра – цены заявки – используется процентная ставка доходности операции репо.

На рынке открываются стандартные инструменты с указанием срока операции репо, например, REPO_KZT_001 – однодневное репо, REPO_KZT_002 – двухдневное репо и т. п.

При вводе заявок в торговую систему Биржи для осуществления сделок участник должен указывать:

- процентную ставку (цену);
- направление заявки (покупка или продажа);
- объем привлекаемых или размещаемых денежных средств (количество);
- код ценной бумаги, используемой в качестве объекта репо (при подаче заявки на покупку денежных средств).

Дата закрытия репо определяется автоматически исходя из стандартного срока репо. Расчет количества ценных бумаг, требуемых под обеспечение проведения операции, производится торговой системой Биржи на основе рыночной оценки стоимости ценных бумаг.

Рыночная оценка осуществляется в соответствии с утвержденной Биржей Методикой оценки ценных бумаг.

Согласно Методике оценки ценных бумаг определяется и дисконтируется оценочная цена для ценной бумаги. Полученная цена отображается при подаче заявки на покупку и указания ценной бумаги, используемой в качестве объекта репо.

Для определения количества ценных бумаг – объектов репо объем операции репо делится на полученную оценочную цену с округлением до целого значения в большую сторону. При этом цена открытия определяется делением объема сделки открытия на полученное значение количества ценных бумаг.

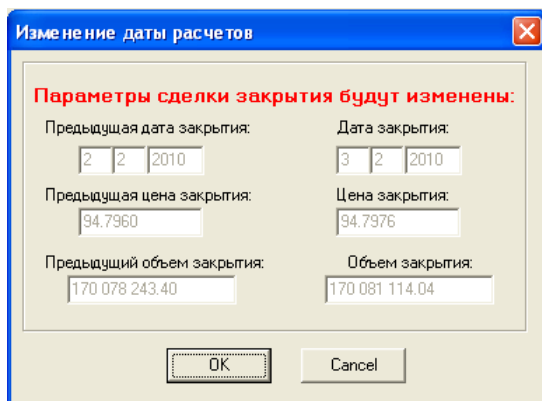
Цена сделки закрытия автоматически рассчитывается торговой системой Биржи по следующему алгоритму: цена открытия умножается на произведение процентной ставки репо и срока сделки (в днях), полученный результат делится на 365 дней и прибавляется к цене открытия.

По сделке закрытия в торговой системе Биржи формируется репо-обязательство, которое в день проведения сделки закрытия напоминает контрагентам о необходимости ее проведения.

Расчеты в деньгах и ценных бумагах по сделкам открытия и закрытия осуществляются в соответствии с правилами Биржи по принципу поставки против платежа через Центральный депозитарий. При открытии репо ценные бумаги блокируются на счете продавца денежных средств до проведения сделки закрытия. В случае если в течение срока операции репо будет происходить выплата купона, деньги перечисляются покупателю денежных средств, то есть участнику, предоставившему ценные бумаги в репо.

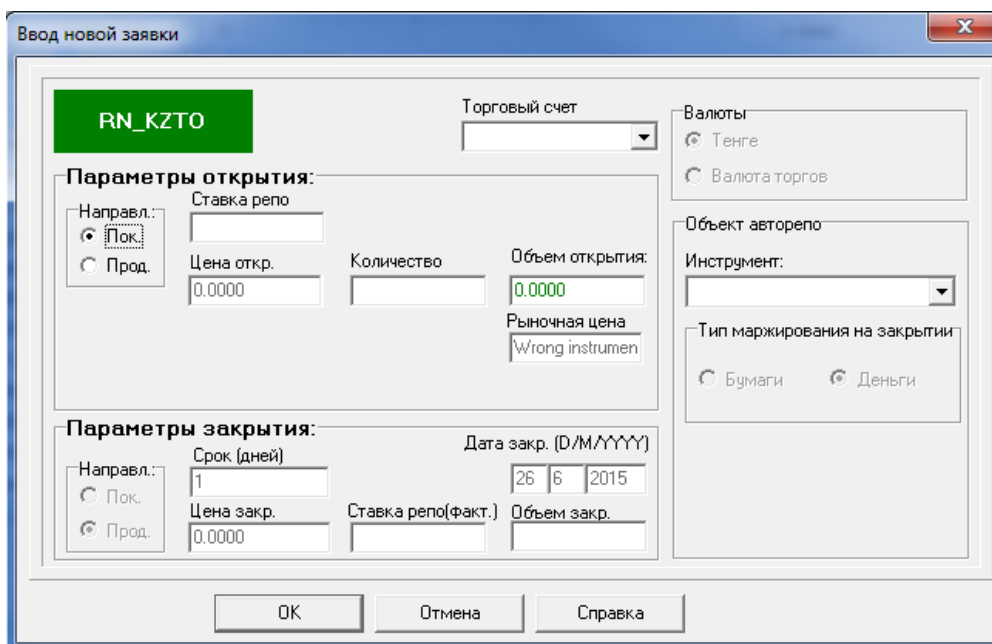
В виду высокой ставки дисконтирования ценных бумаг штрафных санкций при расторжении сделки закрытия репо не установлено. В этом случае ценные бумаги остаются у продавца денежных средств.

При изменении срока операции репо (например, если сделка закрытия выпадает на выходной день или праздничный день закрытие осуществляется в ближайший рабочий день) торговая система Биржи автоматически осуществляет пересчет цены и объема закрытия исходя из фактического срока репо, о чем стороны сделки уведомляются в момент подтверждения сделки закрытия:



7.4. Репо с неттингом

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. Механизм компенсационных платежей отсутствует.



Пример изменения позиционных счетов по заявке/сделке репо с неттингом приведен ниже.

Параметры инструмента KZTO_T2 - ставка маржи 20 %, расчетная цена 900.

Пример изменения позиций при подаче нового типа репо заявки и её удовлетворении. Случай использования встречных требований в качестве обеспечения по сделке открытия.

Исходное состояние счетов:

Счет покупателя репо (покупателя инструмента предмета репо). На начало дня имеются обязательства с датой расчетов "сегодня" (поле T0): 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	0 / 0	0	0	0	1500	2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	0	0	0	0	-2	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Счет продавца репо (продавец инструмента предмета репо). На начало дня обязательства по расчетам и марже отсутствуют: 002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 /	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача заявки на покупку RN_KZTO_001 (покупка бумаг, т.к. предмет репо как в прямом репо – инструмент) – цена -5 (в процентах годовых), количество 2, счет 0001, рыночная цена равна расчетной.

Маржа забирается только под вторую "ногу" репо. Первая "нога" обеспечивается встречными требованиями T0.

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 1799.75	0 / -1800	360	0	0	1140	2000	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 2	0 / -2	360	0	0	0	-2	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 2	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/0	0/0	0/0	0 / 0	0 / 0

Подача встречной заявки со счета 002 (по умолчанию маржа в виде бумаг)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 1800	0 / -1799.75	360	0	0	640	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 2	0 / -2	360	0	2	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / -2	-	-	-	-2	0	0	0	0/0	0/0	0/0	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца

Инструмент	Входящая T0/T2	Текущая T0/T2	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1500	1500	0 / 0	0 / 0	360	0	0	1140	200	1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1800	0 / 1799.75
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	0	0	0	-2	0	0 / -2	0 / 2	0 / 2	0 / 1800	0 / 1799.75
RN_KZTO_00 1	0	2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0/2	0 / 2	0 / 0	0 / 1800	0 / 0

Инструмент	Входящая T0/T2	Текущая T0/T2	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	360	0	0	640	1800	-1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1799.75	0 / 1800
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	360	0	2	0	-2	2	0	0 / 0	0 / 2	0 / 2	0 / 1799.75	0 / 1800
RN_KZTO_00 1	0	-2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	-2	0	0	0	0/-2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 1800

Пример изменения позиций при подаче нового типа репо заявки и её удовлетворении. Случай полного покрытия по сделке открытия.

Исходное состояние счетов:

Счет покупателя репо (покупатель инструмента предмета репо): 0001

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2500	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0

Счет продавца репо (владелец актива): 002

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки	Объем продажи
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 /	0	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	0	2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача заявки на покупку RN_KZTO_001 – цена -5 (в процентах годовых), количество 2, счет 0001, рыночная цена равна расчетной

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 1799.75	0 / -1800	360	0	1800	340	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 2	0 / -2	360	0	1800	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 2	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Подача встречной заявки со счета 002 (по умолчанию маржа в виде бумаг)

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 1800	0 / -1799.75	360	0	0	1000	0	0	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 0	0 / 0
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 2	0 / -2	360	0	2	0	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0
RN_KZTO_001	0	0	0 / 0	0 / -2	-	-	-	-2	0	0	0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0	0 / 0

Сделка заключена, счета покупателя и продавца

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	2500	2500	0 / 0	0 / 0	360	0	1800	340	-1800	1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1800	0 / 1799.75
KZTO_T2 \ KZTO	0	0	0 / 0	0 / 0	360	0	1800	0	2	-2	0	0 / 0	0 / 2	0 / 2	0 / 1800	0 / 1799.75
R_KZTO_001_T	0	2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	0	0	0	0	0 / 2	0 / 2	0 / 0	0 / 1800	0 / 0

Инструмент	Входящая	Текущая	пл. увелич. T0/T2	пл. уменьш. T0/T2	МО	МО(кредит)	Блок (T+2)	Плановый остаток	T0	T1	T2	Нетто / СумТОП	Куплено T0/T2	Продано T0/T2	Объем покупки T0/T2	Объем продажи T0/T2
KZT (счет ЦД)	1000	1000	0 / 0	0 / 0	360	0	0	1000	1800	-1799.75	0	0 / -	- / -	- / -	0 / 1799.75	0 / 1800
KZTO_T2 \ KZTO	2	2	0 / 0	0 / 0	0	0	2	0	-2	2	0	0 / 0	0 / 2	0 / 2	0 / 1799.75	0 / 1800
R_KZTO_001_T	0	-2	0 / 0	0 / 0	-	-	-	-2	0	0	0	0 / -2	0 / 0	0 / 2	0 / 0	0 / 1800

Глава 8. Рынок векселей

8.1. Заключение сделок

Совершение сделок с векселями в торговой системе Биржи осуществляется методом заключения прямых сделок. В качестве объекта торговли на рынке **"Векселя"** выступают плательщики, отображенные в окне **"Финансовые инструменты"**.

Для заключения сделки участники торгов должны осуществить следующие операции:

- выбрать в окне **"Финансовые инструменты"** необходимого плательщика;
- подать прямую заявку по интересующему плательщику (кнопка на панели управления) для заключения прямой сделки с указанием конкретных параметров векселя выбранного плательщика.

Ввод новой заявки

N_KZTK

Направл.:
 Пок. Прод.

Контрагент: NBRK_
Торговый счет: N_001_0000

Цена(KZT): 995.00
Количество: 1
Объем(KZT): 995.00

Расчеты:
 Депозитарий
 Регистратор

Параметры векселя:
Срок платежа: 7/12/2009
Место платежа: г. Алматы, Айтеке Би 67
Авалист:
Номинальная цена и валюта: 1000 KZT
Процентная ставка (% годовых): 0.0000
Дополнительно: Простой вексель ОАО "Казакхтелеком"

OK Cancel Help

В области окна **"Ввод новой заявки"**, помимо общих реквизитов (цены векселя в тенге, количества векселей, направления заявки (покупка или продажа), наименования контрагента, с которым предполагается заключение прямой сделки), следует ввести следующие обязательные реквизиты:

- | | | |
|--------------------------------------|---|--|
| Срок платежа | – | срок платежа по векселю |
| Место платежа | – | место платежа по векселю |
| Авалист | – | авалист |
| Номинальная цена и валюта | – | номинальная цена и валюта векселя |
| Процентная ставка (% годовых) | – | процентная ставка (если на вексель начисляются проценты) |

Глава 9. Срочный рынок

9.1. Условия доступа к торгам срочными контрактами

Используемые в настоящей Главе понятия означают следующее:

Член Биржи – член биржи по категории срочного рынка.

Вариационная маржа – разница между текущими ценами позиций, открытых по срочным контрактам какой-либо серии, и расчетной ценой срочного контракта данной серии, сложившейся в результате биржевых торгов текущего дня.

Гарантийный фонд биржи – фонд, сформированный членами Биржи как следующий уровень гарантийной системы после маржевых взносов и используемый в случае неисполнения кем-либо из членов Биржи своих обязательств при недостаточности маржевых взносов для погашения его обязательств.

Лимит изменения цены – устанавливается по каждой серии срочных контрактов и определяет значение максимально допустимого отклонения цен заявок от расчетной цены предыдущего дня¹⁹.

Лимит открытия позиции – показатель, рассчитываемый отдельно для каждого члена Биржи, определяющий возможность открытия позиций по определенной серии срочных контрактов, в зависимости от внесенных маржевых взносов данным членом²⁰.

Маржевой счет – текущий счет члена Биржи, открываемый Биржей в своей системе учета денег и используемый ею в целях учета начальной маржи члена Биржи и проведения расчетов с ним.

Начальная маржа – остаток денег на маржевом счете члена Биржи, зачисленного им на данный счет для исполнения своих обязательств по начальной и вариационной марже.

Поддерживающая маржа – уровень начальной маржи, при достижении которого член Биржи обязан довести деньги на маржевой счет в порядке устанавливаемом внутренними документами Биржи по срочного рынку.

Резервный фонд биржи – фонд, сформированный из собственных средств биржи как последний уровень гарантийной системы (после маржевых взносов и гарантийного фонда).

Серия срочных контрактов – множество срочных контрактов, описываемых одной спецификацией, имеющих одинаковые сроки и условия исполнения²¹.

Спрэд позиция – пара открытых позиций одинакового объема (в количестве срочных контрактов), имеющих противоположную направленность с разными сериями фьючерсных контрактов одного типа.

Тип срочных контрактов – множество срочных контрактов с различными сроками исполнения, описываемых одной спецификацией²².

Трехмесячный фьючерсный контракт – фьючерсный контракт определенного типа, с ближайшим трехмесячным исполнением (дата исполнения²³ контрактов будет осуществляться поквартально²⁴).

Шестимесячный фьючерсный контракт – фьючерсный контракт определенного типа, с ближайшим шестимесячным исполнением²⁵.

¹⁹ коридор цен, устанавливаемый по каждой серии срочных контрактов в котором может торговаться данный срочный контракт;

²⁰ необходимая сумма денег на маржевом счете для открытия позиции с определенным количеством контрактов.

²¹ трехмесячные и шестимесячные фьючерсные контракты;

²² фьючерсный контракт на курс доллара США, фьючерсный контракт на Индекс KASE;

²³ на данный момент утверждены следующие даты исполнения контрактов:

- 15 сентября;
- 15 декабря;
- 15 марта;
- 15 июня.

Если 15-ое число месяца исполнения приходится на праздничный или выходной день, то днем исполнения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

²⁴ пример схемы исполнения трехмесячных фьючерсных контрактов:

дата открытия	дата исполнения
10 сентября	15 сентября
16 сентября	15 декабря и т.д.

²⁵ пример схемы исполнения шестимесячных фьючерсных контрактов:

Для допуска к торгам срочными контрактами члену Биржи необходимо подать следующие заявления:

- 1) заявление о приеме в члены Биржи по соответствующей категории;
- 2) заявление о допуске к биржевым торгам срочными контрактами.

Далее необходимо провести соответствующие процедуры по перечислению денег:

1. Зачисление денег на счет гарантийного взноса член Биржи может осуществить в любой рабочий день с 09:00 до 18:00 алматинского времени. Для этого необходимо перечислить платеж на корреспондентский счет биржи в Национальном Банке Республики Казахстан (далее – НБРК) с указанием следующих параметров в полях:

- **"КНП" числа – 171;**
- **"Назначение платежа" слова "Гарантийный взнос".**

Указанные параметры полей характеризуют, что данный платеж поступил в рамках пополнение счета гарантийного взноса данного члена на рынке срочных контрактов.

2. Для обеспечения открытия позиций на срочном рынке, члену Биржи также необходимо перечислить маржу в соответствующем размере.

Зачисление денег на маржевой счет член Биржи может осуществить в любой рабочий день с 09:00 до 18:00 алматинского времени. Для этого необходимо перечислить сумму на корреспондентский счет Биржи в НБРК с указанием следующих параметров в полях:

- **"КНП" числа – 171;**
- **"Назначение платежа" слова "Маржевой взнос".**

Указанные параметры полей характеризуют, что данный платеж поступил в рамках пополнения маржевого счета данного члена на рынке срочных контрактов.

3. Списание денег с маржевого счета возможно с 16:00 до 18:00 алматинского времени, по итогам клиринга. Эта процедура осуществляется путем подачи распоряжения на списание с корреспондентского счета Биржи необходимой суммы на счет члена Биржи, который указан в распоряжении. Бэк-офис формирует платеж с указанием следующих параметров в полях:

- **"КНП" числа – 172;**
- **"Назначение платежа" слова "Возврат излишка по маржевому взносу".**

4. Списание денег со счета гарантийного взноса возможно только в случае отсутствия открытых позиций данного члена Биржи. Эта процедура осуществляется путем подачи распоряжения на списание с корреспондентского счета Биржи необходимой суммы на счет члена Биржи, который указан в распоряжении. Бэк-офис формирует платеж с указанием следующих параметров в полях:

- **"КНП" числа – 172;**
- **"Назначение платежа" слова "Возврат излишка гарантийного взноса".**

9.2. Процедура проведения торгов

Все процедуры, проводимые на рынке срочных контрактов подразделяются на:

- предторговые процедуры;

дата открытия	дата исполнения
10 сентября	15 декабря
16 сентября	15 марта и т.д.

- процедуры, проводимые в течение торгового дня;
- после торговые процедуры.

Предторговые процедуры

Перед началом торгового дня с бэк-офиса в торговую систему Биржи поступает следующая информация:

1. параметры по каждой серии срочных контрактов:
 - а) отдельно по каждому коду серии срочных контрактов определенного типа – расчетная цена, ставка лимита изменения цены и ставка начальной маржи;
 - б) отдельно по каждой паре серий срочных контрактов одного типа – ставка по спрэд позициям.
2. параметры, установленные для каждого члена Биржи:
 - а) значение остатка на маржевом счете;
 - б) объем открытой позиций в количестве срочных контрактов и в разрезе каждой серии срочных контрактов.

На основе полученной информации торговая система отображает соответствующие параметры срочного контракта. Для просмотра данных параметров в окне "Финансовые инструменты" нажатием правой клавишей "мыши" по выбранному срочному контракту нужно выбрать опцию "Свойства".

№	Группа	Наименование	Полное наименование	Код
469	USD_Swaps	USDKZT_1_002	USD_TOM_SPT	103
470	Futures_USDKZT	F_USDKZT1009	Трехмесячный фьючерс б/п на доллар США с расчетом в сентябре	F_USDKZT1009
471	Futures_USDKZT	F_USDKZT1012	Котировки	F_USDKZT1012
472	Futures_Indexes	F_INKASE1009	Подокна	F_INKASE1009
473	Futures_Indexes	F_INKASE1012	Подать заявку	F_INKASE1012
474	Indexes_KZ	Index_KASE	Транзитный приказ	Index_KASE
475	Notes	N_ASFI	Отключить	N_ASFI
476	Notes	N_KMTF	График	N_KMTF
477	Notes	N_KZAL	Добавить в Избранные инструменты	N_KZAL
478	Notes	N_KZCR	Добавить	N_KZCR
479	Notes	N_KZTC	Подсказка	N_KZTC
480	Notes	N_KZTK		N_KZTK
481	Notes	N_ORDB	Свойства	N_ORDB

В параметрах выбранного инструмента отображены следующие значения:

- а) срок контракта в месяцах;
- б) значение расчетной цены, выраженное в тенге;
- в) начальная маржа, выраженная в тенге;
- г) верхняя граница лимита изменения цены, выраженная в тенге;
- д) нижняя граница лимита изменения цены, выраженная в тенге;
- е) ставка по спрэд позиции выраженная в процентах.

Параметры инструмента: F_USDKZT1009

Основные | Дополн. | Цена | Позиции | Заявки | Лимиты | Валюты | Swift | Futures

Срок контракта: 3

Расчетная цена: 150.0000

Ставка лимита изменения цен

	в %	в валюте торгов
Ставка начальной маржи	4.0000	6 000.0000
Верхняя граница	2.0000	153.0000
Нижняя граница	2.0000	147.0000

Спред позиции

Код инструмента	Ставка в %
F_USDKZT1012	3.0000

OK Cancel Help

2. Значение остатка на маржевом счете отображается на денежном счете данного члена Биржи. Для просмотра данного остатка необходимо через меню, путем выбора соответствующих пунктов ("Просмотр" – "Структура рынка") открыть окно "Рынки", в котором нажатием правой клавиши "мыши" по выбранному рынку "FutOp" нужно выбрать пункт "Денежные счета".

Рынки: 6

№ /	Наименование	Полное наименование	Код
1	Equities	Рынок акций и облигаций	E
2	ForEx	Рынок иностранных валют	F
3	FutOp	Рынок срочных контрактов	D
4	Indexes	Индексы	
5	Repo	Рынок автоматического реп	
6	TBills	Государственные ценные б	

Секторы Ctrl+Enter

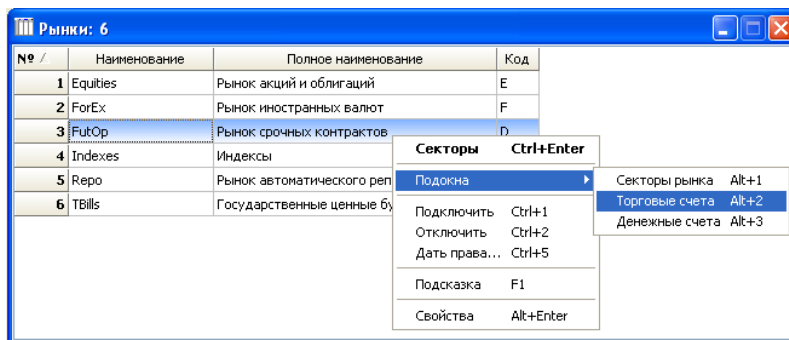
- Подокна
 - Секторы рынка Alt+1
 - Торговые счета Alt+2
 - Денежные счета Alt+3
- Подключить Ctrl+1
- Отключить Ctrl+2
- Дать права... Ctrl+5
- Подсказка F1
- Свойства Alt+Enter

Денежные счета: 1: FutOp

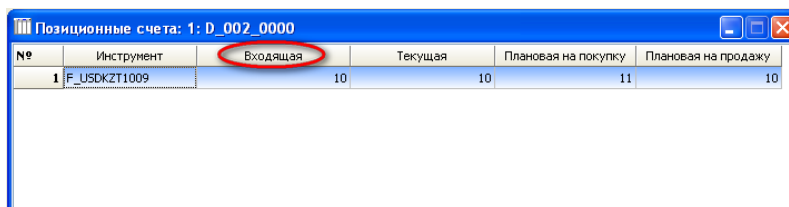
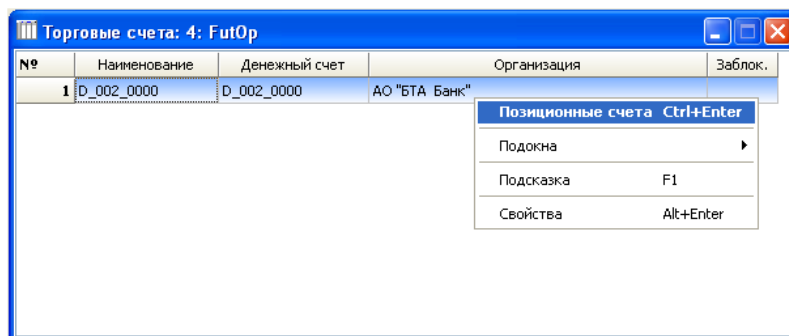
№	Наименование	Контрагент	Входящая	Текущая	Плановая на покупку
1	D_002_0000	TURAL	1 000 000.00	1 000 000.00	1 000 000.00

На денежном счете учитываются следующие позиции:

- 1) входящая позиция, которая равна сумме в тенге на маржевом счете, данного члена Биржи;
 - 2) текущая позиция равна входящей позиции минус необходимая сумма маржевых взносов по заключенным сделкам;
 - 3) плановая позиция равна входящей позиции минус необходимая сумма маржевых взносов по заключенным сделкам и поданным заявкам.
3. Значение позиций данного члена Биржи можно просмотреть на позиционном счете через меню, путем выбора соответствующих пунктов ("Просмотр" – "Структура рынка") открыть окно "Рынки", в котором нажатием правой клавиши "мыши" по выбранному рынку "FutOp" нужно выбрать пункт "Торговые счета".



Далее в окне "Торговые счета" двойным щелчком либо нажатием правой клавиши "мыши" открыть окно "Позиционные счета".

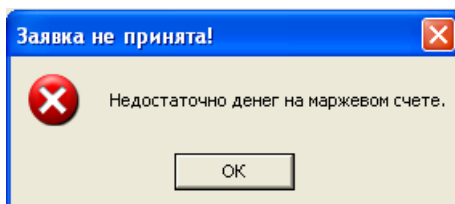


На позиционном счете учитываются следующие позиции:

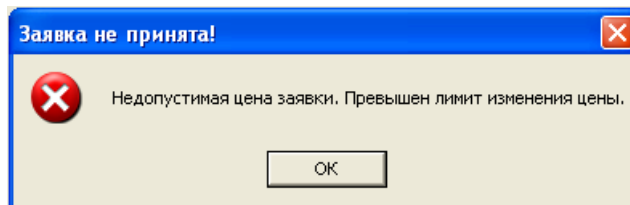
- 1) входящая позиция равна значению остатка на позиционном счете;
- 2) текущая позиция равна входящей позиции минус количество срочных контрактов от сделок на продажу плюс количество срочных контрактов от сделок на покупку;
- 3) плановая позиция на продажу равна текущей позиции минус количество срочных контрактов по заявкам на продажу. Плановая позиция на покупку равна текущей позиции плюс количество срочных контрактов по заявкам на покупку.

Процедуры в течение торгового дня

Торги на срочном рынке проводятся методом непрерывного встречного аукциона. Торговая система проверяет в автоматическом режиме возможность подачи членом Биржи заявки на покупку или продажу, а именно проверяет на удовлетворение заявки лимиту изменения цены и лимиту открытия позиции. В случае недостаточности денег на маржевом счете, остаток по которому отображается через денежные счета в поле "Плановая", торговая система выдает соответствующее сообщение.



При превышении лимита изменения цены выдет следующее сообщение.



В ходе торгов в торговую систему из бэк-офиса могут поступать файлы с изменениями в следующих случаях:

- при увеличении остатка на маржевом счете члена Биржи;
- при изменении ставки по лимиту изменения цены;
- при изменении ставки по начальной марже по какой-либо серии срочных контрактов или спрэд позиции;
- при изменении значения расчетной цены.

После торговые процедуры

После закрытия торгов с 15:30 по 16:00 алматинского времени биржа осуществляет клиринг по итогам торгового дня и проводит расчеты для приведения всех параметров к новым значениям. В результате бэк-офис вычисляет новое значение расчетной цены по каждой серии срочных контрактов и формирует по каждому члену Биржи биржевое свидетельство, которое включает в себя расчет:

- 1) вариационной маржи;
- 2) начальной маржи;
- 3) расчет денежных требований и обязательств.

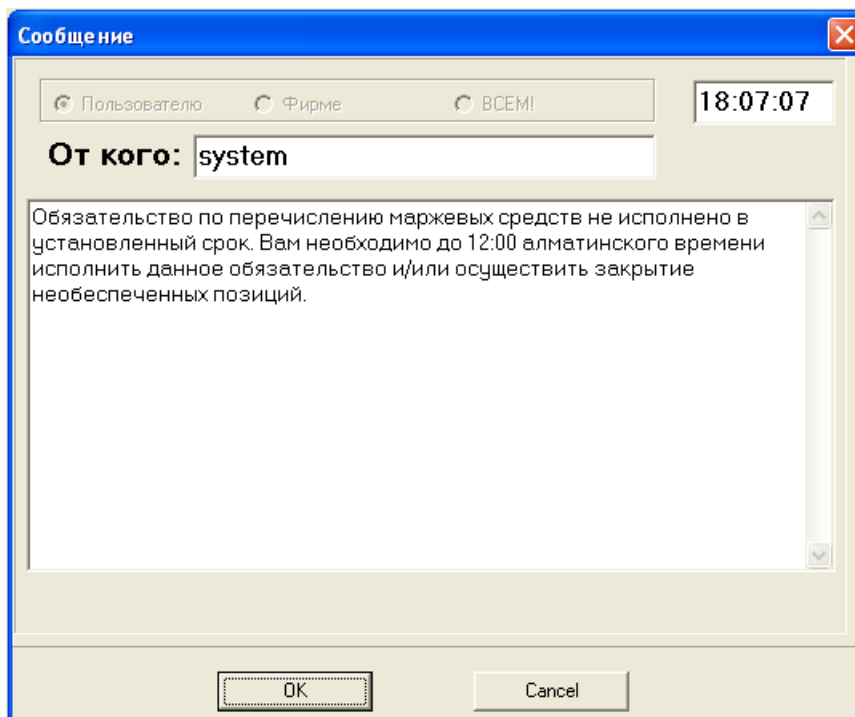
Все обязательства и требования члену Биржи выставляются на нетто-основе, а для целей удобства подсчета членами Биржи обязательств своих клиентов, расчет начальной маржи предоставляется в разрезе каждого клиента.

Если по итогам клиринговой сессии остаток на маржевом счете члена Биржи превышает сумму, заблокированную под его открытые позиции, то он имеет право снять сумму превышения с 16:00 до 18:00 алматинского времени текущего дня. Для этого член Биржи должен предоставить в Расчетную палату распоряжение на перечисление требуемой суммы с указанием номера счета.

Если остаток на маржевом счете становится меньше поддерживающей маржи, то в расчете денежных требований и обязательств члена Биржи, входящее в биржевое свидетельство, в поле **"Излишек/недостаток средств на маржевом счете"** будет указано недостающее количество денежных средств для удовлетворения требований по маржевому взносу.

9.3. Неисполнение обязательств

Ежедневно до 10:00 алматинского времени торговая система проверяет значение остатка на маржевом счете членов Биржи. Членам, не исполнившим свои обязательства по перечислению суммы маржевого взноса автоматически направляется сообщение о необходимости самостоятельно до 12:00 алматинского времени осуществить пополнение маржевого счета и/или осуществить закрытие собственных или клиентских открытых позиций, удовлетворяющих задолженности по маржевому счету.



В 12:00 торговая система в автоматическом режиме проверяет на удовлетворение текущих открытых позиций члена Биржи не исполнившего до 10:00 алматинского времени свои обязательства, требованию по маржевому взносу. В случае если у члена Биржи имеется задолженность по маржевому взносу, торговая система информирует маклера о необходимости закрыть его открытые позиции так, чтобы данные позиции удовлетворяли остатку на маржевом счете. Маклер биржи временно блокирует торговые счета данного члена, до полного исполнения им своих обязательств.²⁶

При недостаточности денег на маржевом счете члена Биржи для покрытия его обязательств бэк-офис формирует поручение на списание недостающей суммы с его гарантийного взноса при проведении клиринговой сессии. В случае недостаточности данной суммы её списание производится равными долями с гарантийных взносов членов Биржи, не имеющих задолженности по маржевым счетам. В случае недостаточности и этой суммы, списание производится с резервного фонда биржи.

В направляемом данному члену Биржи биржевом свидетельстве в таблице **"Расчет денежных требований и обязательств"** указываются соответствующие суммы задолженности данного члена Биржи в поле:

– **"Обязательства Гарантийному и Резервному фондам"**.

Эти обязательства должны быть исполнены членом Биржи в течение трех рабочих дней, в противном случае биржа отстраняет его от торгов.

В случае неисполнения членом Биржи своих обязательств по истечению трех рабочих дней, всем членам Биржи, гарантийные взносы которых были использованы для покрытия задолженности данного члена Биржи, в биржевом свидетельстве в разделе **"Расчет денежных требований и обязательств"** в полях **"Обязательства по Гарантийному и Резервному фондам"** указывается сумма, использованная на погашение. Данную сумму необходимо внести в течение пяти последующих рабочих дней, в рамках пополнения суммы гарантийного фонда. Если данный член Биржи не исполняет данное требование за указанный выше период – биржа отстраняет его от торгов.

²⁶ Допуск к торгам после отстранения нельзя осуществить раньше следующего торгового дня.

9.4. Случаи приостановки торгов на рынке срочных контрактов

При определенных условиях, складывающихся на рынке срочных контрактов, торговая система приостанавливает торги по всем сериям срочных контрактов данного типа.

В случае подачи заявки на покупку торговая система приостанавливает торги по всем сериям срочных контрактов данного типа на 15 минут при выполнении следующих условий:

- 1) объем заявки превышает на 50 или более процентов суммарный объем открытых позиций по всем фьючерсным контрактам данного типа;
- 2) заявка находится в торговой системе непрерывно в течение 30 минут;
- 3) цена заявки больше или равно верхнему пороговому значению.

При этом значение верхнего лимита изменения цены по этой серии срочных контрактов увеличивается на значение произведения расчетной цены, лимита изменения цены и величины 0,25²⁷, а значение нижнего лимита изменения цены остается неизменным.

В случае подачи заявки на продажу торговая система приостанавливает торги по всем сериям срочных контрактов данного типа на 15 минут при выполнении следующих условий:

- 1) объем заявки превышает на 50 или более процентов суммарный объем открытых позиций по всем фьючерсным контрактам данного типа;
- 2) заявка находится в торговой системе непрерывно в течение 30 минут;
- 3) цена заявки меньше или равна нижнему пороговому значению.

При этом значение нижнего лимита изменения цены по этой серии срочных контрактов уменьшается на значение произведения расчетной цены, лимита изменения цены и величины 0,25, а значение верхнего лимита изменения цены остается неизменным.

Такая процедура осуществляется торговой системой не более двух раз в течение торгового дня. При этом в случае приостановки торгов, торговая система отправляет соответствующее сообщение.

По истечении 15 минут, торги по данной серии срочных контрактов возобновляются.

Глава 10. Электронный документооборот

10.1. Электронная цифровая подпись

Во встроенном в торговую систему Биржи механизме обмена электронными документами реализованы возможности:

- получения электронных документов Биржи в формате Acrobat Reader® (биржевых свидетельств, отчетов, счетов, иных электронных документов) с сервера торговой системы Биржи на терминал пользователя;
- подписания полученного пользователем электронного документа Биржи собственной электронной цифровой подписью в подтверждение получения, просмотра и согласия с содержанием этого документа и его отправка на сервер торговой системы Биржи;
- возможность получения пользователями текстовых отчетов по сделкам в режиме реального времени;
- возможность получения от Биржи файлов любых типов и размеров (из папки "Общие").

²⁷ =0,25 в случае отсутствия задолженности у всех клиринговых членов по маржевому взносу, =0,1 в случае если хотя бы у одного клирингового члена имеется задолженность.

Примечание Указанные выше опции доступны только тем пользователям, которые используют **SSL-соединение** с сервером торговой системы Биржи (то есть используют программно-криптографические средства защиты информации при работе с торговой системой Биржи в режиме удаленного доступа).

Электронные документы Биржи по мере их формирования сервером торговой системы Биржи подписываются электронной цифровой подписью Биржи и помещаются в специальные каталоги на сервере, после чего становятся доступными пользователям для получения. Полученные пользователями электронные документы Биржи перемещаются в архивные каталоги на сервере торговой системы Биржи, откуда могут получаться пользователями неоднократно.

После получения электронные документы Биржи можно просмотреть и распечатать на терминале пользователя.

При просмотре пользователями полученных электронных документов биржи их подлинность проверяется автоматически (путем проверки электронной цифровой подписи Биржи). По желанию пользователей они могут проверить подлинность полученных электронных документов Биржи, не просматривая их.

Внимание! Для просмотра полученных от Биржи электронных документов на терминале пользователя должна быть установлена программа Acrobat Reader® версии 5.0 или выше. Данная программа может быть бесплатно скопирована через сеть Интернет с адреса <http://get.adobe.com/reader/> Инсталлятор данной программы имеется и в торговой системе Биржи (меню "**Отчеты**" – функция "**Получить документы с сервера**" – тип "**Общие**" – файл "**AIN_ACRBT_281003.exe**").


10.2. Получение электронных документов с сервера торговой системы Биржи

Электронные документы Биржи могут быть получены с сервера торговой системы Биржи двумя способами:

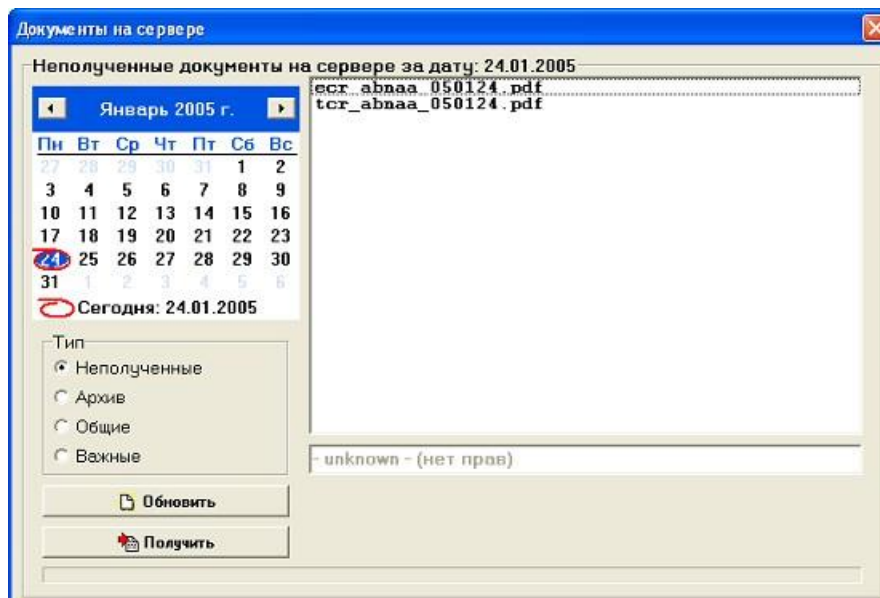
- автоматически.

При входе пользователя в торговую систему Биржи и выходе из нее торговая система Биржи автоматически проверяет наличие новых электронных документов за текущую дату, которые предназначены для организации, представляемой данным пользователем, и при их наличии выдает соответствующее сообщение;

- по желанию пользователя.

В любой момент работы с торговой системой Биржи пользователь может получить информацию о наличии электронных документов, которые предназначены для организации, представляемой данным пользователем, используя функцию "**Получить документы с сервера**" меню "**Отчеты**" либо нажав на панели инструментов кнопку .

После перехода в режим получения информации об имеющихся электронных документах на экране терминала пользователя появляется окно "**Документы на сервере**"



С помощью кнопок, расположенных на панели управления окном, пользователь может выбрать из папок ("Тип") желаемые электронные документы: неполученные (по умолчанию – на текущую дату), из архива, общие или важные (к ним относятся, например, счета на уплату периодических членских взносов и/или биржевых сборов).

В верхней части области просмотра отображаются наименования файлов электронных документов. Краткое описание файла дается в нижней части области просмотра.

Используя расположенную на панели управления окном кнопку **"Получить"**, либо по двойному щелчку мыши пользователь может получить с сервера торговой системы Биржи на свой терминал выделенный им электронный документ.

Нажатие кнопки **"Обновить"** на панели управления окном позволяет пользователю еще раз запросить сервер торговой системы Биржи о наличии на текущую дату новых электронных документов Биржи, которые предназначены для организации, представляемой данным пользователем.

Примечание Пользователь может не иметь прав на получение некоторых электронных документов, которые предназначены для организации, представляемой данным пользователем. В этом случае при попытке получить файл пользователем будет получено сообщение.

Данный документ может быть получен только пользователями, которые обладают правом работы с ним.

Из архива пользователь может получить еще неполученные или ранее уже полученные им электронные документы, используя расположенную на панели управления окном кнопку **"Архив"** и выбрав в календаре панели управления необходимую дату.

К категории общих относятся файлы любых типов и размеров, рассылаемые Биржей пользователям и, по мнению Биржи, необходимые пользователям для работы с ее торговой системой, например, инсталлятор Acrobat Reader®, последняя версия клиентской части торговой системы Биржи, руководства пользователя торговой системы Биржи. Такие файлы электронной подписью Биржи не подписываются. После их получения пользователем с сервера торговой системы Биржи они автоматически помещаются в папку **"Общие"** на терминале пользователя; их просмотр или запуск производится двойным щелчком "мыши".


10.3. Просмотр и печать электронных документов

Электронные документы Биржи, полученные с сервера ее торговой системы, могут быть просмотрены и распечатаны двумя способами:

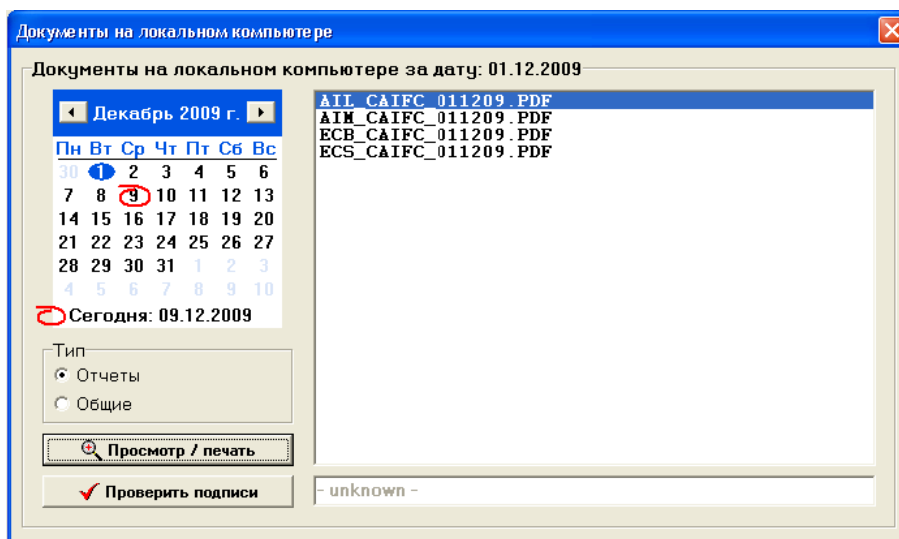
- автоматически.

После получения электронных документов Биржи с сервера ее торговой системы на экране терминала пользователя появится сообщение, в котором будет предложено перейти в режим просмотра и печати принятых электронных документов;

- по желанию пользователя.

в любой момент работы с торговой системой Биржи пользователь может просмотреть и распечатать электронные документы, используя функцию **"Просмотреть/напечатать документы"** меню **"Отчеты"** либо нажав на панели инструментов кнопку .

После перехода в режим просмотра и печати электронных документов на экране терминала пользователя появляется окно **"Документы на локальном компьютере"**.



С помощью кнопок, расположенных на панели управления окном, пользователь может выбрать электронные документы одного из следующих типов:

Тип	Описание	Каталог в папке "Client"
"Отчеты"	электронные документы за определенную дату	IncomingPDF
"Общие"	общие файлы	CommonFiles

В верхней части области просмотра отображаются наименования файлов электронных документов. Краткие описания файлов даются в нижней части области просмотра.

К выбранным электронным документам с помощью кнопок, расположенных на панели управления окном, пользователь может применить одно из следующих действий:

- осуществить просмотр и печать электронного документа с помощью кнопки **"Просмотр/печать"**;
- проверить подлинность электронных документов с помощью кнопки **"Проверить подписи"** (в соответствии с главой **"Структура торговой системы Биржи"**);

После нажатия кнопки **"Просмотр/печать"** (либо двойного щелчка "мышью") осуществляется запуск программы Acrobat Reader® для просмотра и печати электронного документа.

Сведения об электронной цифровой подписи включаются в электронный документ отдельной страницей и содержат:

- дату и время подписания электронного документа;
- информацию о том, кем подписан электронный документ;
- цифровую сигнатуру электронной цифровой подписи.

Последняя строка сведений об электронной цифровой подписи содержит информацию о результатах проверки его подлинности. В случае подлинности электронного документа эта строка должна содержать запись **"ПОДПИСЬ: ВЕРНА"**.

Внимание! После просмотра электронного документа пользователь должен подписать его своей электронной цифровой подписью, за исключением случая, когда в третьей позиции наименования файла этого электронного документа находится символ **"N"** или когда этот электронный документ относится к категории общих.

В случае необходимости подписания электронного документа, просмотренного пользователем, его электронной цифровой подписью на экране терминала пользователя появляется сообщение, которым торговая система Биржи предлагает пользователю подписать данный электронный документ его электронной цифровой подписью в подтверждение его получения, просмотра и согласия с его содержанием и вернуть данный электронный документ Бирже.

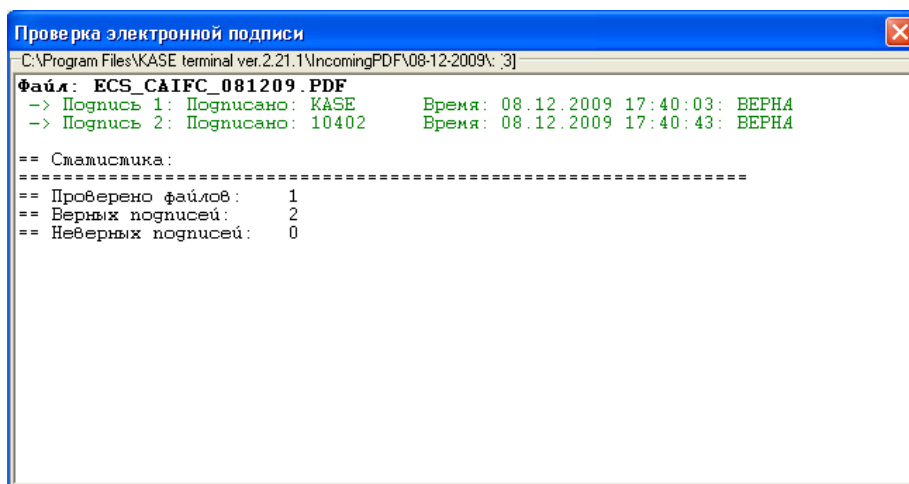
При выборе варианта **"Да"** электронный документ подписывается электронной цифровой подписью пользователя и передается на сервер торговой системы Биржи.

При выборе варианта **"Нет"** электронный документ не подписывается электронной цифровой подписью пользователя и не передается на сервер торговой системы Биржи.

Внимание! Во избежание спорных ситуаций, связанных с электронными документами, пользователям необходимо обращать особое внимание на результаты проверки подлинности электронных документов Биржи перед их подписанием своими электронными цифровыми подписями и отправкой на Биржу.

10.4. Проверка подлинности электронного документа

После нажатия кнопки **"Проверить подписи"** в окне **"Документы на локальном компьютере"** торговая система Биржи осуществляет проверку подлинности полученных электронных документов Биржи и выдает сообщение о результатах этой проверки в окне **"Проверка электронной подписи"**.



```
Проверка электронной подписи
C:\Program Files\KASE terminal ver.2.21.1\IncomingPDF\08-12-2009\; [3]
Файл: ECS_CAIFC_081209.PDF
-> Подпись 1: Подписано: KASE      Время: 08.12.2009 17:40:03: ВЕРНА
-> Подпись 2: Подписано: 10402    Время: 08.12.2009 17:40:43: ВЕРНА

== Статистика:
=====
== Проверено файлов:      1
== Верных подписей:      2
== Неверных подписей:    0
```

Наличие записи **"Подпись ... ВЕРНА"** является свидетельством подлинности проверенного электронного документа.

Наличие записи **"Подпись ... НЕВЕРНА"** является свидетельством того, что электронный документ не прошел проверку его подлинности.

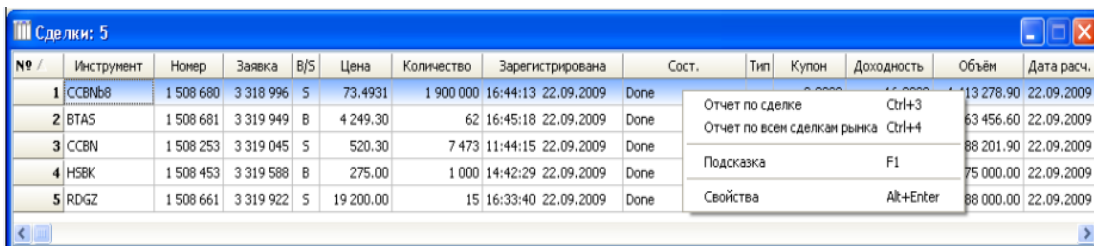
Внимание! Во избежание спорных ситуаций, связанных с электронными документами, пользователям необходимо обращать особое внимание на результаты проверки подлинности электронных документов Биржи.

Примечание Полученные с сервера торговой системы Биржи электронные документы, в третьей позиции наименований файлов которых находится символ **"N"**, и электронные документы, относящиеся к категории общих, предназначены сугубо для их использования организациями, представляемыми пользователями (без необходимости уведомления Биржи о получении, просмотре электронных документов и согласии с их содержанием). Соответственно, торговая система Биржи не предоставляет пользователям возможности подписывать эти электронные документы своими электронными цифровыми подписями.

10.5. Получение отчетов по сделкам

Встроенный в торговую систему Биржи механизм обмена электронными документами предоставляет пользователям возможность получения с сервера торговой системы Биржи в режиме реального времени отчетов по заключенным сделкам, подписанных электронной цифровой подписью Биржи.

Для получения таких отчетов необходимо использовать функции **"Отчет по сделке"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+3**) или **"Отчет по всем сделкам рынка"** ("горячие" клавиши – **Ctrl+4**) меню, ниспадающего при нажатии правой клавиши "мыши" во время нахождения курсора на строке окна **"Сделки"**, соответствующей выбранной сделке.



№ /	Инструмент	Номер	Заявка	B/S	Цена	Количество	Зарегистрирована	Сост.	Тип	Купон	Доходность	Объём	Дата расч.
1	ССВ№8	1 508 680	3 318 996	5	73.4931	1 900 000	16:44:13 22.09.2009	Done				13 278.90	22.09.2009
2	BTAS	1 508 681	3 319 949	B	4 249.30	62	16:45:18 22.09.2009	Done				63 456.60	22.09.2009
3	ССВН	1 508 253	3 319 045	5	520.30	7 473	11:44:15 22.09.2009	Done				88 201.90	22.09.2009
4	НБК	1 508 453	3 319 588	B	275.00	1 000	14:42:29 22.09.2009	Done				75 000.00	22.09.2009
5	RDGZ	1 508 661	3 319 922	5	19 200.00	15	16:33:40 22.09.2009	Done				88 000.00	22.09.2009

Context menu options:

- Отчет по сделке (Ctrl+3)
- Отчет по всем сделкам рынка (Ctrl+4)
- Подсказка (F1)
- Свойства (Alt+Enter)

При выборе функции **"Отчет по сделке"** отчет формируется только по выбранной сделке.

При выборе функции **"Отчет по всем сделкам рынка"** отчет формируется по всем сделкам, заключенным на рынке выбранной сделки.

Проверка подлинности полученных отчетов по сделкам осуществляется торговой системой Биржи автоматически.

Файлы указанных отчетов хранятся в каталоге **"dealsign"** папки **"Client"**.

Примечание Отчеты по сделкам, получаемые с сервера торговой системы Биржи в режиме реального времени, формируются по запросам пользователей в любой момент их работы с торговой системой Биржи и используются только для внутренних потребностей организаций, представляемых данными пользователями. Соответственно, пользователям не требуется подписывать эти отчеты своими электронными цифровыми подписями в подтверждение их получения, просмотра и согласия с их содержанием и отправлять эти отчеты на Биржу.

10.6. Совместимость с предыдущими версиями торговой системы Биржи

Для обеспечения непрерывности работы пользователей с торговой системой Биржи в данной ее версии сохранен механизм обмена электронными документами, действовавший в предыдущих ее версиях и позволявший обмениваться текстовыми файлами.

Предыдущий механизм обмена текстовыми файлами может быть использован при выборе функций **"Получить текстовые файлы с сервера"** и **"Просмотреть/напечатать текстовые файлы"** меню **"Отчеты"**.

Глава 11. Работа с графиками

11.1. Работа с графиками

Для наглядности изменений цен сделок с финансовыми инструментами торговая система Биржи позволяет строить их графики трех видов:

- **линейный график (line chart)** – график в виде сплошной линии, соединяющей точечные значения цены сделок с выбранным финансовым инструментом;
- **"японские свечи" (japanese candlesticks charting)** – график, на котором каждому отдельному временному интервалу соответствует свеча – прямоугольник с двумя отрезками, примыкающими к его внешней части по вертикальной оси (возможны варианты свечи только с одним отрезком или совсем без отрезков);

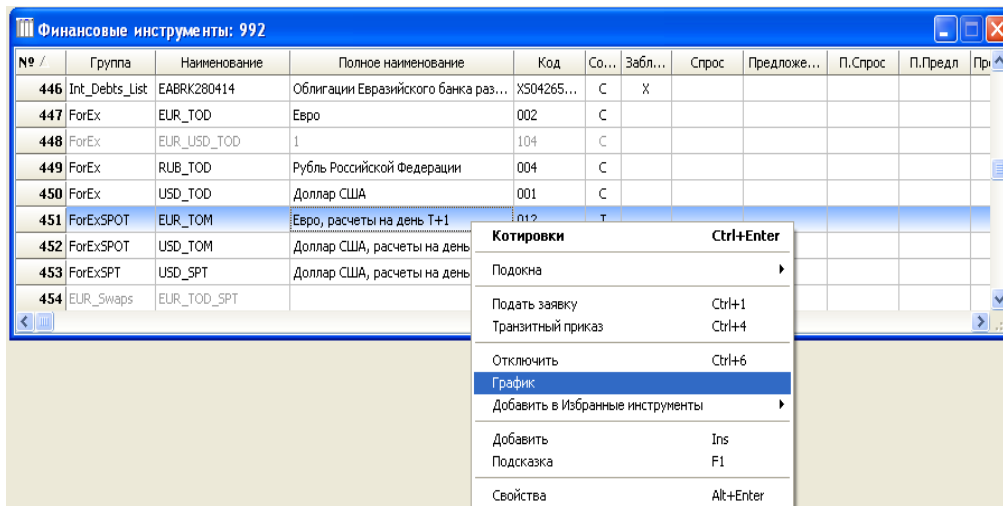
Внимание! Прямоугольник именуется телом свечи (real body), а его горизонтальные стороны образуются ценами открытия и закрытия по выбранному финансовому инструменту в данном временном интервале.
Незакрашенное тело свечи соответствует ситуации, когда цена закрытия превышает цену открытия, а закрашенное – противоположной ситуации.
Отрезки именуются тенями (shadows), образуются максимальной и минимальной ценами сделок с выбранным финансовым инструментом в данном временном интервале и различаются на верхнюю (upper) и нижнюю (lower) тени относительно тела свечи.

- **столбиковый график (bar chart или vertical line chart)**, схожий с "японскими свечами", но отличающийся тем, что в нем тело свечи не выделяется – цены открытия и закрытия выделяются насечками на вертикальном отрезке, образуемом максимальной и минимальной ценами сделок с выбранным финансовым инструментом в данном временном интервале; цвет отрезка, как и в "японских свечах", характеризует соотношение цен закрытия и открытия – отрезок более темного цвета означает, что цена закрытия была ниже цены открытия, отрезок более светлого цвета – что цена закрытия превысила цену открытия.

Одновременно с демонстрацией графика цен сделок с выбранным финансовым инструментом торговая система Биржи показывает гистограмму объема этих сделок в том же временном интервале.

11.2. Выбор графика

Для построения графика необходимо в окне **"Финансовые инструменты"** подвести курсор к строке нужного финансового инструмента и нажать правую клавишу "мыши". Во всплывающем окне следует выбрать функцию **"График"**.



По умолчанию торговая система Биржи строит в отдельном окне линейный график изменения цен сделок с выбранным финансовым инструментом (его наименование указывается в заголовке окна) в ходе текущей торговой сессии с одноминутным интервалом и с указанием цен в виде точек на графике.

Примечание Линейный график по параметрам сделок, заключенных в ходе текущей торговой сессии, строится по ценам последних сделок в заданных временных интервалах.

Для построения "японских свечей" или столбикового графика необходимо включить опцию **"Штриховые графики"** и выбрать необходимый вид графика.

Торговая система Биржи позволяет совмещать линейный график с "японскими свечами" или столбиковым графиком.

При включении опции **"Цены"** в график будут включены значения цен и объемов сделок с выбранным финансовым инструментом.

Кроме того, торговая система Биржи позволяет при построении графиков настраивать их цвета и величину временных интервалов, а также демонстрировать графики в объемном виде (опция **"3D"**) и показывать на них объем сделок нарастающим итогом (опция **"Объем нарастающим"**).

Для того чтобы напечатать график, необходимо в его окне нажать кнопку **"Печать"**, в результате чего на экране появится окно печати **"TeeChart Print Preview"**, в котором можно выбрать параметры печати.

11.3. Построение графиков предыдущих торговых сессий

Для того чтобы построить график предыдущих торговых сессий, следует установить переключатель **"Период"** в режим **"Предыдущие сессии"**, выбрать необходимый архивный период ("Неделя", "Месяц", "Год") и нажать кнопку **"Обновить"**.

По умолчанию при выборе режима построения графика предыдущих торговых сессий торговая система Биржи в качестве архивного периода выбирает последнюю истекшую неделю и автоматически вставляет ее даты.

Примечание Линейный график по параметрам сделок, заключенных в ходе предыдущих торговых сессий, строится по средневзвешенным ценам этих сделок.

Даты архивного периода можно установить в ручную, нажав после их установки кнопку **"Обновить"**.

Краткое описание методов торгов

Метод непрерывного встречного аукциона

С началом торгов по финансовому инструменту разрешается ввод заявок по нему в торговую систему Биржи. Заявки могут быть как лимитированные, так и рыночные. Для упрощения понимания метода ниже рассматриваются только лимитированные заявки. Особенности ввода рыночных заявок рассмотрены в пункте "**Метод открытых торгов**".

Все принятые торговой системой Биржи заявки по одному и тому же виду финансового инструмента сводятся в очереди неудовлетворенных заявок на продажу и покупку. Заявки ранжируются в очереди в порядке возрастания цен, указанных в заявках на продажу, и убывания цен в заявках на покупку, а при равных ценах – в порядке очередности их приема торговой системой Биржи, что при заключении сделок дает приоритет заявкам, поданным раньше.

Принятая торговой системой Биржи заявка на продажу/покупку удовлетворяется за счет имеющихся заявок из очереди неудовлетворенных заявок на покупку/продажу. При этом удовлетворение заявки начинается с заявки на покупку/продажу, содержащей наивысшую/низшую цену, и поступательно продолжается либо до полного удовлетворения данной заявки на продажу/покупку, либо до исчерпания доступных по цене заявок на покупку/продажу. Частично неудовлетворенные заявки остаются в соответствующих очередях неудовлетворенных заявок.

Сделка считается заключенной в объеме удовлетворения заявки и по цене удовлетворения. Участник, заключивший сделку методом открытых торгов, не знает своего контрагента. Изменение ранее введенной заявки производится путем ее удаления с последующим вводом новой скорректированной заявки.

Аннулирование ранее введенной заявки производится путем ее удаления. Во всех случаях изменение и аннулирование ранее введенной заявки допускается только в ее неудовлетворенном в ходе торгов объеме.

После закрытия торгов ввод, изменение и аннулирование заявок трейдерами прекращаются, и все заявки, находящиеся в очередях неудовлетворенных заявок, аннулируются.

Метод заключения прямых сделок

В торговой системе Биржи по отдельным финансовым инструментам может быть предоставлена возможность заключения прямых сделок между участниками.

Для заключения прямой сделки участник осуществляет подачу прямой заявки тому участнику торгов, с кем он намеревается заключить сделку с указанием ценовых, количественных и иных условий. Участник, получивший прямую заявку, удовлетворяя ее, заключает сделку купли/продажи.

Участникам предоставляется также возможность подачи прямых (индикативных) котировок. Индикативные котировки, означают намерение участника торгов, их подавшего, заключить сделку с любым другим участником торгов на условиях, указанных в котировке.

Для заключения сделки на основании индикативных котировок участник торгов, заинтересованный в заключении сделки, обращается к участнику торгов, объявившему котировку, путем подачи прямой заявки на объявленных в котировке условиях.

Участник торгов, объявивший индикативную котировку, имеет право не заключать сделку по объявленной им котировке.

Метод специализированных торгов

Метод специальных торгов предназначен для проведения в торговой системе Биржи размещений или выкупов ценных бумаг и иных финансовых инструментов.

Размещение или выкуп проводятся в предварительно объявленный всем участникам торгов день и период приема заявок. Заявки от участников в данный период могут приниматься только одного направления (на покупку или продажу) в зависимости от условий размещения или выкупа. Участники могут подавать лимитированные и рыночные заявки и имеют возможность видеть только собственные заявки.

По окончании периода приема заявок Биржа формирует сводную ведомость заявок, ранжированных по цене, с указанием объема рыночных заявок без наименований участников торгов, подавших заявки, и передает ее организации, осуществляющей проведение размещения или выкупа, для определения цены отсечения и объема размещения или выкупа.

После определения цены отсечения происходит удовлетворение заявок. В первую очередь удовлетворяются рыночные заявки. Они удовлетворяются в объеме, не превышающем разрешенный объем удовлетворения рыночных заявок (в процентах от объема размещения или выкупа); если рыночных заявок больше, то они удовлетворяются частично в соответствии с процентным соотношением разрешенного объема к объему рыночных заявок.

Удовлетворение лимитированных заявок осуществляется двумя методами:

- удовлетворение по цене отсечения;
- удовлетворение по заявленной цене.

При удовлетворении заявок по цене отсечения удовлетворение осуществляется по единой цене – цене отсечения. При удовлетворении заявок по заявленной цене удовлетворение осуществляется по цене, которая была указана в заявке при ее подаче в торговую систему Биржи. Удовлетворение начинается с заявок, имеющих наибольшую или наименьшую цену, до достижения цены отсечения и удовлетворения объема размещения или выкупа.

По цене отсечения может быть удовлетворена только часть поданной заявки. Среди заявок, поданных по одинаковой цене, приоритет имеют заявки, поданные раньше по времени.

Метод франкфуртских торгов

В объявленный период времени от участников принимаются только лимитированные заявки. По окончании приема заявок торговой системой Биржи определяется цена отсечения исходя из цены, по которой возможно проведение максимального объема сделок.

В случае множественности цен отсечения, то есть если по нескольким различным ценам обеспечиваются одинаковые максимально возможные объемы сделок, в качестве цены отсечения выбирается цена, при которой разница между удовлетворяемыми объемами финансового инструмента на продажу и покупку имеет минимальное значение.

В случае наличия двух цен, обеспечивающих одинаковые объемы сделок при одинаковых минимальных значениях разницы, в качестве цены отсечения выбирается средняя арифметическая величина между этими двумя ценами.

Если разница между этими двумя ценами составляет минимально возможный шаг изменения цены данного финансового инструмента и, следовательно, установление средней арифметической цены в качестве цены заключения сделок невозможно, то в качестве цены отсечения выбирается:

- более высокая цена, если суммарный объем предварительных заявок на покупку превышает суммарный объем предварительных заявок на продажу;
- более низкая цена, если суммарный объем предварительных заявок на продажу превышает суммарный объем предварительных заявок на покупку.

Все сделки заключаются по установленной цене отсечения.

По результатам торгов может быть удовлетворена только часть поданной заявки. При удовлетворении заявок учитывается приоритет времени подачи заявок по одной цене.

Метод фиксинга

Объявляется период времени приема предварительных заявок на покупку и продажу по установленной стартовой цене. По окончании периода приема заявок объявляется разница между суммарными объемами на продажу и покупку по стартовой цене.

В случае положительной разницы (предложение превышает спрос) маклер понижает курс финансового инструмента с заранее установленным шагом, в случае отрицательной разницы (спрос превышает предложение) – повышает его. Участники могут подавать дополнительные заявки на сокращение разницы между спросом и предложением.

В момент уравнивания спроса и предложения курс фиксируется, и все сделки заключаются по единой фиксированной цене.

Для удобства и быстроты восприятия при подаче заявок направление выделяется цветом:

- **"зеленым"** – покупка;
- **"красным"** – продажа.

Основные стандартные, специальные и "горячие" клавиши

1. Стандартные клавиши

Клавиша/ сочетание клавиш	Назначение
Insert	создать объект
Esc	заккрыть диалоговое окно
Alt+Enter	открыть свойства объекта
Ctrl+F4	заккрыть активное окно
Delete	удалить объект
Shift+Esc	заккрыть все окна
Ctrl+Enter	аналог двойного щелчка мыши
Alt+X, Alt+F4	выйти из программы

2. Специальные клавиши

Клавиша/ сочетание клавиш	Назначение
F2	выбрать финансовые инструменты из списка доступных
F7	блокировать доступ
Ctrl+F11	перейти на английский язык
Alt+F3	разорвать соединение терминала пользователя с сервером торговой системы Биржи
Alt+F10	экспортировать содержимое активного окна в текстовый файл
F5	обновить информацию
F11	блокировать доступ
Ctrl+F12	перейти на русский язык
Alt+F8	установить параметры соединения терминала пользователя с сервером торговой системы Биржи
*1	подать заявку на покупку
1	
—	подать заявку на продажу

3. "Горячие" клавиши

Сочетание клавиш	Назначение
Ctrl+A	перейти в окно "Денежные счета" (Money Accounts)
Ctrl+C	перейти в окно "Валюты" (Foreign Currencies)
Ctrl+E	перейти в окно "Описание отчетов" (Reports Description)
Ctrl+G	перейти в окно "Группы инструментов" (Groups of Instruments)
Ctrl+I	перейти в окно "Финансовые инструменты" (Instruments)
Ctrl+K	перейти в окно "Таблица обязательных котировок" (Market– makers Quotations Table)
Ctrl+M	перейти в окно "Рынки" (Markets)
Ctrl+O	перейти в окно "Организации" (Organizations)
Ctrl+Q	перейти в окно "Заявки" (Quotations)
Ctrl+S	перейти в окно "Секторы рынка" (Market Sectors)
Ctrl+U	перейти в окно "Пользователи" (Users)
Ctrl+W	перейти в окно "Прямые котировки" (Indicative Direct Quotations)
Ctrl+Y	зарезервировано
Ctrl+B	перейти в окно "Сообщения" для просмотра сообщений (Message Board)
Ctrl+D	перейти в окно "Сделки" (Deals)
Ctrl+F	перейти в окно "Фирмы" (Firms)
Ctrl+H	перейти в окно "Сообщения" для отправки сообщения (Hello!)
Ctrl+J	зарезервировано
Ctrl+L	перейти в окно "Предварительные периодические заявки" (Preliminary Periodic Quotations)
Ctrl+N	перейти в окно "Неактивные транзитные приказы" (Non-active Transit Orders)
Ctrl+P	перейти в окно "Позиционные счета" (Position Accounts)
Ctrl+R	перейти в окно "Репозитивные обязательства" (Repo Liabilities)
Ctrl+T	перейти в окно "Транзитные приказы" (Transit Orders)
Ctrl+V	Перейти в окно "Таблица оценочных цен" (Valuation Prices Table)
Ctrl+X	перейти в окно "Торговые счета" (Trade Accounts)
Ctrl+Z	перейти в окно "Параметры групп" (Parameters of Groups)