

«Утвержден»
решением Правления
АО «Товарная биржа «ЕТС»,
протокол № 1611
от «07» сентября 2022 года

ПОРЯДОК

АО «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система» по отмене биржевых сделок, заключенных с использованием технологий автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных и внешних программно-технических систем, скорость обращений от которых к биржевой торговой системе составляет более двух обращений в секунду

г. Алматы

Настоящий Порядок АО «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система» по отмене биржевых сделок, заключенных с использованием технологий автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных и внешних программно-технических систем, скорость обращений от которых к биржевой торговой системе составляет более двух обращений в секунду (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями Правил биржевой торговли, утвержденных уполномоченным государственным органом РК в сфере регулирования биржевого товарного рынка, и определяет порядок выявления использования торговых роботов и отмены биржевых сделок со стандартизированными товарами, заключенных с их применением.

Статья 1. Общие положения

1.1. В целях настоящего Порядка используются следующие определения, термины:

Администратор -	штатный работник Биржи, уполномоченный на выполнение функций администрирования Торговой системы.
Биржа -	Акционерное общество «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система».
Департамент торгов -	структурное подразделение Биржи, ответственное за сопровождение аккредитованных брокеров, дилеров по их участию в биржевых торгах на торговых секциях Биржи.
Заявка на продажу (покупку) Товара/Заявка -	предложение Участника торгов о продаже (покупке) Товара (оферта) или уведомление Участника торгов о принятии предложения о покупке (продаже) Товара (акцепт), содержащее все условия, необходимые для заключения сделки купли-продажи Товара в Торговой системе в соответствии с Правилами биржевой торговли.
Клиринговый центр -	Товарищество с ограниченной ответственностью «Клиринговый центр ЕТС»

Правила биржевой торговли	действующие Правила биржевой торговли, утвержденные уполномоченным государственным органом Республики Казахстан в сфере регулирования биржевого товарного рынка страны, и размещенные на интернет-ресурсе Биржи: www.ets.kz
Рабочая станция -	совокупность программных и аппаратных средств, обеспечивающая удаленный доступ Участника торгов к Торговой системе и позволяющая Трейдеру в этой Торговой системе: объявлять (изменять, удалять) Заявки, заключать сделки, получать раскрываемую Биржей информацию и осуществлять иные действия, необходимые для Участия в Торгах, в соответствии с Правилами биржевой торговли и другими нормативными документами Биржи.
Сделка -	биржевая сделка, заключенная в Торговой системе на основании объявленных сторонами сделки Заявок.
Торговые роботы	технологии автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных и внешние программно-технические системы, скорость обращений от которых к торговой системе составляет более двух обращений в секунду, для выставления заявок и заключения сделок.
Торги -	процесс, проводимый в рамках настоящих Правил, направленный на совершение сделок по биржевым товарам на основе электронных заявок, поданных в электронную торговую систему товарной биржи, обеспечивающую автоматизацию процесса заключения биржевых сделок
Торговая система -	комплекс вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования Биржи, необходимый для проведения биржевых торгов и обеспечивающий автоматизацию процесса заключения биржевых сделок, а также сбора, хранения, обработки и раскрытия информации.

Участник торгов -	аккредитованные на торговых секциях Биржи брокер, заключающий сделки с Товаром по поручению и за счет своих Клиентов, либо дилер, заключающий сделки с Товаром в своих интересах и за свой счет.
--------------------------	--

Иные определения, термины, используемые в Порядке, толкуются в соответствии с Правилами биржевой торговли, иным законодательством Республики Казахстан, внутренними нормативными документами Биржи.

1.2. Членам товарной биржи запрещается использовать технологии автоматизированной ускоренной обработки и подачи данных и внешние программно-технические системы, скорость обращений от которых к электронной торговой системе товарной биржи составляет два и более обращения в секунду, для выставления заявок и заключения сделок. Сделки, заключенные с использованием подобных технологий, признаются ничтожными и подлежат аннулированию товарной биржей.

1.3. Автоматизированные программно-технические средства сбора, подготовки заявок к вводу и направления их в электронную торговую систему товарной биржи, а также получения и обработки информации из торговой системы, работающей в режиме, обеспечивающем контроль со стороны членов товарной биржи за всеми действиями, совершаемыми с ее использованием, в обязательном порядке сертифицируются решением товарной биржи.

1.4. Сделки, заключенные участниками торгов с использованием подобных программно-технических средств, не сертифицированных товарной биржей, признаются ничтожными и подлежат аннулированию товарной биржей.

Биржевые товары по аннулированным товарной биржей сделкам повторно выставляются на торги в рамках следующей и (или) дополнительной торговой сессии с соблюдением требований Закона Республики Казахстан «О товарных биржах».

Статья 2. Порядок выявления и фиксации использования торговых роботов

2.1. Доступ к Торговой системе Биржи допускается только с использованием клиентского терминала «ETS Plaza Workstation» версии не ниже, чем 1.96.1.18.

2.2. Администратор перед началом каждой торговой сессии осуществляет контроль за версиями, подключенных клиентских терминалов.

2.3. Выявление использования несертифицированных Биржей технологий для подачи заявок в Торговую систему, включая торговых роботов, производится Администратором.

2.4. Выявление производится на основании периодического мониторинга и постоянного анализа журнала транзакций Торговой системы Администратором.

2.5. Основанием для фиксации нарушения является наличие более двух транзакций в секунду, поданных в Торговую систему с одной рабочей станции участника торгов, а также выявление использования Участником

торгов несертифицированных Биржей технологий.

Статья 3. Порядок отмены сделок, заключенных с использованием торговых роботов

3.1. При выявлении факта использования торговых роботов, несертифицированных Биржей технологий, Администратор уведомляет уполномоченного работника Департамента торгов об инциденте по электронной корпоративной почте. В уведомлении содержится наименование кода участника торгов, кода рабочей станции, фрагмент журнала, подтверждающий факт использования торговых роботов и коды сделок, заключенных с данной рабочей станции, если таковые имеются/ информация о несертифицированных технологиях.

3.2. Уполномоченный работник Департамента торгов, при наличии заключенных сделок с рабочей станции нарушителя, уведомляет руководство Биржи служебной запиской с указанием кода участника торгов, кода рабочей станции, кода сделок, заключенных с данной рабочей станции, признающимися ничтожными и подлежащими отмене согласно требованиям Правил биржевой торговли.

3.3. На основании данной служебной записки Правлением Биржи выносится решение об отмене признанных ничтожными сделок и к виновной стороне (сторонам) сделки применяются следующие меры дисциплинарного воздействия:

- при первичном факте использования торговых роботов/несертифицированных технологий к нарушителю применяется штрафные санкции в размере биржевой комиссии по совершенной биржевой сделке;
- при повторном факте использования торговых роботов/несертифицированных технологий к нарушителю применяется штрафные санкции в размере биржевой комиссии по совершенной биржевой сделке, а также приостановление его аккредитации на Бирже сроком на шесть месяцев.

3.4. Решение Правления Биржи доводится до ответственных сотрудников Биржи и Клирингового центра.

3.5. На основании решения Правления Биржи ответственный работник Клирингового центра добавляет примечание о ничтожности такой сделки в поле «Примечание» и высвобождает биржевое обеспечение по данной сделке с обеих сторон.

3.6. Уполномоченный работник Департамента торгов уведомляет участников торгов по сделкам, совершенным с нарушениями, об их отмене и о примененных мерах дисциплинарного воздействия к нарушителям.

3.7. Бухгалтерия Биржи выставляет счет брокеру/дилеру нарушителю на оплату штрафа.

3.8. Уполномоченный работник Департамента торгов, при подаче данных о взимании комиссии, отмененные сделки не учитывает. Все данные по отмененным сделкам он хранит в реестре отмененных сделок, без ограничения хранения по срокам.

Статья 4. Переходные положения

4.1. Вопросы, не регламентированные настоящим Порядком, подлежат разрешению согласно положениям Правил биржевой торговли и иных внутренних нормативных документов Биржи.