

«Утверждена»
приказом АО «Товарная Биржа «Каспий»
№170-П от «16» июля 2025 года



**Методология
по выявлению автоматизированных
алгоритмов в процессе участия в биржевых
торгах и о принимаемых мерах
ответственности на
АО «Товарная Биржа «Каспий»**

г. Астана
2025 г.

 CASPY COMMODITY EXCHANGE	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»	
	Редакция 1	Лист 2 из 7

1. Общие положения

2.1 Настоящая Методология разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан №155-IV от 04.05.2009 года «О товарных биржах» (далее – Закон РК «О товарных биржах») и Правилами биржевой торговли, утверждённых приказом и.о. МНЭ РК от 30.03.2015 г. №280 (далее – Правила биржевой торговли).

2.1 Методология определяет порядок выявления, ограничения и предотвращения использования автоматизированных алгоритмов в процессе подачи заявок, а также мер ответственности за их использование на АО «Товарная Биржа «Каспий» (далее – АО «ТБК»).

2.1 Цель Методологии - обеспечение равного и справедливого доступа к проводимым торгам на АО «ТБК», минимизация манипулятивного воздействия на рынок, поддержание стабильной работы электронной торговой системы товарной биржи (далее - ЭТСТБ) в ходе проведения торгов, соблюдения законодательства в сфере биржевой торговли и предотвращение злоупотребления со стороны участников.

2. Нормы законодательства

2.1 Согласно пункту 1-2 статьи 19 Закона РК «О товарных биржах», 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.

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.

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 настоящего Закона.

 CASPY COMMODITY EXCHANGE	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»		
		Редакция 1	Лист 3 из 7

2.2. Согласно пункту 2 статьи 19 Закона РК «О товарных биржах», брокер, дилер и маркет-мейкер обязаны соблюдать требования, установленные Законом, иными законодательными актами Республики Казахстан, нормативными правовыми актами уполномоченного органа, внутренними документами товарной биржи.

3. Определение подачи заявок в ЭТСТБ и ее автоматизации

3.1. Подача заявок в ЭТСТБ – это процесс со стороны уполномоченного работника аккредитованного члена биржи, действующего на основании доверенности и/или иного соответствующего документа, который в процессе участия в торгах проводит несколько действий для того, чтобы его заявка попала в ЭТСТБ.

3.2. Описание торгового процесса в терминале ЭТСТБ (<https://trade.ccx.kz/>):

3.2.1. В назначенное время в торговом терминале ЭТСТБ (страница «Торги») открывается торговая сессия по определенному инструменту.

Открытие торговой сессии сопровождается снятием размытия с двух основных элементов, в которых содержится торговый функционал:

- Биржевой стакан.
- Окно «Подача заявки».

3.2.2. Торговый процесс, а именно процесс оформления и подачи заявки пользователем осуществляется в окне «Подача заявки» и состоит из следующих механических действий:

3.2.2.1. Для пользователя-Брокера:

- Механическое перемещение курсора мыши.
- Клик по ячейке «Цена за единицу».
- Ввод, либо вставка значения в ячейку «Цена за единицу».
- Наведение курсора на ячейку «Количество лотов» (либо «Количество товара»).
- Клик по ячейке «Количество лотов» (либо «Количество товара»).
- Ввод, либо вставка значения в ячейку «Количество лотов» (либо «Количество товара»).
- Наведение курсора на необходимую кнопку в строке «Баланс» (при необходимости).
- Клик по кнопке (при необходимости).
- По умолчанию в строке «Баланс» выбрано значение баланса «Клиента».
- Наведение курсора на поле «Выбора клиента» (при необходимости).

 CASPY COMMODITY EXCHANGE	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»		
		Редакция 1	Лист 4 из 7

- Клик по полю «Выбора клиента» (при необходимости). По умолчанию в поле «Выбор клиента» выбран избранный клиент в разделе «Мои клиенты».

- Наведение курсора на наименование необходимого Клиента в выпадающем списке (при необходимости).

- Клик по наименованию Клиента (при необходимости).
- Наведение курсора на кнопку «Подать заявку».
- Клик по кнопке «Подать заявку».

3.2.2.2. Для пользователя - Дилера:

- Механическое перемещение курсора мыши.
- Клик по ячейке «Цена за единицу».
- Ввод, либо вставка значения в ячейку «Цена за единицу».
- Наведение курсора на ячейку «Количество лотов» (либо «Количество товара»).

- Клик по ячейке «Количество лотов» (либо «Количество товара»).
- Ввод, либо вставка значения в ячейку «Количество лотов» (либо «Количество товара»).

- Наведение курсора на кнопку «Подать заявку».
- Клик по кнопке «Подать заявку».

3.3. Автоматизация - это процесс использования со стороны члена товарной биржи в ЭТСТБ программных решений и алгоритмов (таких как: макросы, скрипты, боты (роботы) для автоматизации задач, текстовые боты, web-боты, внешние программно-технические системы, роботизированная автоматизация процессов, bind (привязывание макроса механического процесса передвижения курсора мыши на клавиши/кнопки)) и др. для выполнения рутинных задач без участия человека или минимального его участия в данном процессе.

3.4. Автоматизация как процесс позволяет повысить скорость подачи заявки, а также ускорить обработку данных.

3.5. Любые формы автоматизации, направленные на обход установленных Правилами биржевой торговли и/или автоматическое выполнение действий, предусмотренных для ручного выполнения, считаются нарушением Закона РК «О товарных биржах» и влекут за собой санкции в виде выставления штрафов, приостановления либо аннулирования аккредитации и обязательной отмене заявок и (или) аннулирование сделок.

3.6. В целях борьбы с автоматизацией, устанавливается запрет на любое использование инструментов автоматизации, описанных в пункте 3.3. настоящей Методологии, но не ограничиваясь ими, на всех этапах торгового процесса.

	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»		
		Редакция 1	Лист 5 из 7

4. Выявление Автоматизации в торговом процессе и принимаемые меры

4.1. Заявки, которые поданы в ЭТСТБ и соответствуют одному из следующих параметров:

4.1.1 скорость обращений при подаче в ЭТСТБ составляет два и более обращения в секунду;

4.1.2. минимальный интервал между подачей заявок с одной учетной записи составляет менее чем 1,2 секунды;

4.1.3. подана менее чем за 1,119 секунды;

4.1.4. поданные с иным нарушением установленного порядка подачи заявки - автоматически признаются ничтожными и подлежат удалению, а сделки, заключенные на основании данных заявок, подлежат аннулированию.

4.2. Заявки, которые поданные в ЭТСТБ в интервале от 1,119 до 3 секунд, подлежат обязательному мониторингу с целью выявления возможного использования автоматизированных средств подачи (роботов).

4.3. Заявки, поданные в ЭТСТБ со скоростью от 3 секунд и выше, могут быть проанализированы в рамках выборочного мониторинга на предмет соответствия требованиям и отсутствия признаков автоматизации подачи.

4.4. Заявки, поданные в ЭТСТБ не соответствующие по одному и (или) нескольким нижеуказанным подпунктам действий заявки:

4.4.1. Механическое (ручное) передвижение курсора мыши - управление положением курсора на экране монитора компьютера при помощи физического перемещения мыши (или другого манипулятора) по поверхности исключительно ручным методом. Визуальное отображение перемещение курсора мыши при этом исключает прямые линии и углы;

4.4.2. Клик по ячейке «Цена за единицу» - ячейка активируется, появляется курсор;

4.4.3. Ввод, либо вставка значения в ячейку «Цена за единицу» - отображаются введенные значения;

4.4.4. Наведение курсора на ячейку «Количество лотов» либо «Количество товара» - загорается ореол ячейки;

4.4.5. Клик по ячейке «Количество лотов» либо «Количество товара» - ячейка активируется, появляется курсор;

4.4.6. Ввод, либо вставка значения в ячейку «Количество лотов» либо «Количество товара») - отображаются введенные значения. В случае, если количество лотов/товара превышает заданное отделом торгов, количество лотов/товара автоматически изменяется на максимальное;

4.4.7. Наведение курсора на необходимую кнопку в строке «Баланс» (при необходимости) – появляется неявное свечение неактивной кнопки, активная кнопка не изменяет свой вид;

	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»		
		Редакция 1	Лист 6 из 7

4.4.8. Клик по кнопке (при необходимости) – клик по неактивной кнопке, изменяет кнопку на активную, кнопка меняет цвет на синий;

4.4.9. Наведение курсора на поле «Выбор клиента» (при необходимости) ничего не меняет;

4.4.10. Клик по полю «Выбор клиента» (при необходимости) – выпадает окно выбора клиентов;

4.4.11. Наведение курсора на наименование необходимого Клиента в выпадающем списке (при необходимости) – ничего не меняет;

4.4.12. Клик по наименованию Клиента (при необходимости) – сворачивает окно выбора клиента, в поле «Выбор клиента» появляется выбранный пользователем клиент;

4.4.13. Наведение курсора на кнопку «Подать заявку» ничего не меняет.

4.4.14. Клик по кнопке «Подать заявку» загорается ореол кнопки, заявка появляется в стакане, окно подачи заявки сбрасывается - автоматически признаются ничтожными и подлежат удалению, а сделки, заключенные на основании данных заявок, подлежат аннулированию как несоответствующие указанным параметрам.

Мониторинг заявок от пользователя «Дилер» по подпунктам 4.4.7 – 4.4.12 не применяется.

5. Все обращения в ЭТСТБ при любых действиях автоматически фиксируются.

6. При целесообразности и по своему усмотрению ответственные работники АО «ТБК» имеют право проводить мониторинг обращений к ЭТСТБ по любым действиям, в том числе по поданным заявкам на предмет соответствия требованиям и отсутствия признаков автоматизации подачи.

4.7. При выявлении Автоматизации в торговом процессе в случаях, описанных в пунктах 4.2., 4.3., 4.4. настоящей Методологии, ответственными работниками товарной биржи принимается решение о признании поданных заявок ничтожными, заявки подлежат аннулированию, сделки, заключенные на основании данных заявок, подлежат аннулированию.

5. Ответственность и права

5.1. Меры дисциплинарного воздействия применяются к членам АО «ТБК» решением товарной биржи (соответствующий приказ) при выявлении нарушений, описанных в статье 4 настоящей Методологии.

5.2. К мерам дисциплинарного воздействия относятся:

5.2.1 предупреждение;

5.2.2. штраф;

5.2.3 лишение права принимать участие в биржевых торгах в течение определенного периода времени;

 CASPY COMMODITY EXCHANGE	Методология по выявлению автоматизированных алгоритмов в процессе участия в биржевых торгах и о принимаемых мерах ответственности на АО «Товарная Биржа «Каспий»		
		Редакция 1	Лист 7 из 7

5.2.4. приостановление аккредитации на товарной бирже сроком до шести месяцев;

5.2.5 прекращение аккредитации в качестве члена Биржи.

5.3. Меры дисциплинарного воздействия применяются согласно порядку, предусмотренному утверждёнными Правилами применения мер дисциплинарного воздействия к брокерам, дилерам за нарушение Правил биржевой торговли, внутренних документов АО «Товарная Биржа «Каспий».

5.5. Члены товарной биржи, использующие несертифицированное АО «ТБК» или запрещённое программное обеспечение, несут ответственность в соответствии с настоящей Методологией, Правилами биржевой торговли и иными документами товарной биржи.

5.6. Члены товарной биржи, которые не согласны с решением товарной биржи, по применённым к ним штрафным санкциям вправе обратиться в Биржевой арбитраж АО «ТБК».

5.7. При обращении члена товарной биржи в биржевой арбитраж по пункту 5.6. настоящей Методологии действие аккредитации такого члена товарной биржи приостанавливается до принятия решения биржевого арбитража.

5.8. В случае удовлетворения биржевым арбитражем исковых требований члена биржи, товарная биржа отменяет санкцию в виде штрафа по которой было принято решение и возобновляет аккредитацию.

5.9. В случае отказа биржевым арбитражем в удовлетворении исковых требований члена биржи, товарная биржа вправе приостановить действие аккредитации такого члена сроком до шести месяцев.

6. Заключительные положения

6.1. Настоящая Методология подлежит пересмотру и актуализации в случае изменения нормативной правовой базы, появления новых технологических решений и/или выявления пробелов в текущих процедурах контроля.

6.2. Участники торгов обязаны ознакомиться с настоящей Методологией и нести ответственность за соблюдение её положений, в соответствии с установленными нормами.

6.3. Методология вступает в силу с момента ее утверждения решением товарной биржи и обязательна для исполнения всеми членами АО «ТБК».