

Биржалық саудаға қатысу процесінде
автоматтандырылған алгоритмдерді
анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар
биржасы» АҚ-да қабылданатын
жауапкершілік шаралары

Астана қ.
2025 ж.

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	2-ші бет/ 7 беттен

1. Жалпы ережелер

1.1 Осы Әдістеме Қазақстан Республикасының 2009 жылғы 4 мамырдағы №155-IV «Тауарлық биржалар туралы» Заңына (бұдан әрі - ҚР «Тауарлық биржалар туралы» Заңы) және Қазақстан Республикасы Ұлттық экономика министрлігі міндетін атқарушының 2015 жылғы 30 наурыздағы №280 бұйрығымен бекітілген Биржалық сауда қағидаларына (бұдан әрі - Биржалық сауда қағидалары) сәйкес әзірленді.

1.2 Әдістеме «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да (бұдан әрі - «КТБ» АҚ) өтінімдерді беру процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау, шектеу және олардың алдын алу тәртібін, сондай-ақ оларды қолданғаны үшін жауапкершілік шараларын айқындайды.

1.3 Әдістemeniң мақсаты - «КТБ» АҚ-да өткізілетін сауда-саттыққа тең және әділ қолжетімділікті қамтамасыз ету, нарыққа манипуляциялық әсерді азайту, сауда өткізу кезінде тауар биржасының электрондық сауда жүйесінің (бұдан әрі - ТБЭСЖ) тұрақты жұмысын қолдау, биржалық сауда саласындағы заңнаманы сақтау және қатысушылар тарапынан теріс пайдаланудың алдын алу.

2. Заңнама нормалары

2.1 ҚР «Тауарлық биржалар туралы» Заңының 19-бабы 1-2-тармағына сәйкес, тауар биржасының мүшелеріне автоматтандырылған жеделдетілген деректерді өңдеу және беру технологияларын, сондай-ақ тауар биржасының электрондық сауда жүйесіне секундына екі немесе одан да көп рет жүгіну жылдамдығымен жұмыс істейтін сыртқы бағдарламалық-техникалық жүйелерді өтінімдерді орналастыру және мәмілелерді жасасу үшін пайдалануға тыйым салынады.

Осындай технологияларды пайдалану арқылы жасалған мәмілелер жарамсыз деп танылады және тауар биржасы тарапынан жойылуға жатады.

Өтінімдерді енгізуге дайындау және оларды тауар биржасының электрондық сауда жүйесіне жіберу, сондай-ақ сауда жүйесінен ақпарат алу және өңдеу үшін қолданылатын, мүшелердің аталған құралды пайдалану арқылы жасалатын барлық әрекеттерін бақылауды қамтамасыз ететін режимде жұмыс істейтін автоматтандырылған бағдарламалық-техникалық құралдар міндетті түрде тауар биржасының шешімімен сертификатталуға тиіс.

Тауар биржасы тарапынан сертификатталмаған осындай бағдарламалық-техникалық құралдарды пайдаланып, саудаға қатысушылар жасаған мәмілелер жарамсыз деп танылады және жойылуға жатады.

Тауар биржасы жойған мәмілелер бойынша биржалық тауарлар осы Заң талаптарын сақтай отырып, келесі және (немесе) қосымша сауда сессиясы аясында қайта саудаға шығарылады.

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	3-ші бет/ 7 беттен

2.2. 19-баптың 2-тармағына сәйкес, Қазақстан Республикасының «Тауарлық биржалар туралы» Заңына сай, брокер, дилер және маркет-мейкер Заңда, Қазақстан Республикасының өзге де заңнамалық актілерінде, уәкілетті органның нормативтік құқықтық актілерінде және тауар биржасының ішкі құжаттарында белгіленген талаптарды сақтауға міндетті.

3. ТБЭСЖ-ға өтінімдерді беру және оны автоматтандыру ұғымы

3.1. ТБЭСЖ-ға өтінім беру - бұл биржаның аккредиттелген мүшесінің сенімхат және/немесе басқа да тиісті құжат негізінде әрекет ететін уәкілетті қызметкері тарапынан саудаға қатысу процесінде өзінің өтінімін ТБЭСЖ-ға енгізу үшін бірқатар іс-әрекеттерді орындау үдерісі.

3.2. ТБЭСЖ терминалындағы сауда процесінің сипаттамасы (<https://trade.ccx.kz/>):

3.2.1. Белгіленген уақытта ТБЭСЖ сауда терминалында («Сауда» беті) белгілі бір құрал бойынша сауда сессиясы ашылады.

Сауда сессиясының ашылуы сауда функционалы бар екі негізгі элементтің бұлыңғырлығының алынуымен қатар жүреді:

- Биржалық стакан.
- «Өтінім беру» терезесі.

3.2.2. Сауда процесі, яғни пайдаланушының өтінімді рәсімдеуі мен беру процесі «Өтінім беру» терезесінде жүзеге асырылады және келесі механикалық әрекеттерден тұрады:

3.2.2.1. Брокер-пайдаланушы үшін:

- Тышқан курсорын механикалық жылжыту.
- «Бірлік үшін баға» ұяшығына басу.
- «Бірлік үшін баға» ұяшығына мәнді енгізу немесе қою.
- Курсорды «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына апару.
- «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына басу.
- «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына мәнді енгізу немесе қою.
- Қажет болған жағдайда «Баланстағы» қажетті түймеге курсорды апару.
- Қажет болған жағдайда түймені басу.
- Әдепкі бойынша «Баланста» «Клиент» балансы таңдалады.
- Қажет болған жағдайда «Клиентті таңдау» өрісіне курсорды апару.

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	4-ші бет/ 7 беттен

- Қажет болған жағдайда «Клиентті таңдау» өрісіне басу. Әдепкі бойынша «Клиентті таңдау» өрісінде «Менің клиенттерім» бөліміндегі таңдалған клиент таңдалады.
- Қажет болған жағдайда ашылмалы тізімнен қажетті Клиенттің атауына курсорды апару.
- Қажет болған жағдайда Клиенттің атауына басу.
- «Өтінім беру» түймесіне курсорды апару.
- «Өтінім беру» түймесін басу.

3.2.2.2. Дилер-пайдаланушы үшін::

- Тышқан курсорын механикалық жылжыту.
- «Бірлік үшін баға» ұяшығына басу.
- «Бірлік үшін баға» ұяшығына мәнді енгізу немесе қою.
- Курсорды «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына апару.
- «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына басу.
- «Лоттар саны» (немесе «Тауар саны») ұяшығына мәнді енгізу немесе қою.
- «Өтінім беру» түймесіне курсорды апару.
- «Өтінім беру» түймесін басу.

3.3. Автоматтандыру - бұл тауар биржасының мүшесі тарапынан ТБЭСЖ-да макростар, скрипттер, боттар (роботтар) арқылы тапсырмаларды автоматтандыру, мәтіндік боттар, web-боттар, сыртқы бағдарламалық-техникалық жүйелер, роботтандырылған процесс автоматтандыру, bind (тышқан курсорының механикалық қозғалысын батырмаларға/түймелерге байлау) және т.б. сияқты бағдарламалық шешімдер мен алгоритмдерді пайдалану арқылы адам қатысуынсыз немесе оның ең аз қатысуымен күнделікті тапсырмаларды орындау процесі.

3.4. Автоматтандыру процесі өтінім беру жылдамдығын арттыруға, сондай-ақ деректерді өңдеуді жеделдетуге мүмкіндік береді.

3.5. Биржалық сауда ережелерінде белгіленген талаптарды айналып өтуге және/немесе қолмен орындалуы тиіс әрекеттерді автоматты түрде орындауға бағытталған автоматтандырудың кез келген түрі «Қазақстан Республикасының тауарлық биржалар туралы» Заңының бұзылуы болып саналады және айыппұл салу, аккредиттеуді тоқтата тұру немесе жою, сондай-ақ өтінімдерді және (немесе) мәмілелерді міндетті түрде жою түріндегі санкцияларға әкеледі.

3.6. Автоматтандырумен күресу мақсатында, осы Әдістеменің 3.3-тармағында сипатталған, бірақ олармен шектелмейтін автоматтандыру құралдарын сауда процесінің барлық кезеңдерінде пайдалануға тыйым салынады.

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	5-ші бет/ 7 беттен

4. Автоматтандыруды сауда процесінде анықтау және қабылданатын шаралар

4.1. ТБЭСЖ-ға берілген және төмендегі параметрлердің кем дегенде біріне сәйкес келетін өтінімдер:

4.1.1 ТБЭСЖ-ға өтінім беру кезіндегі жүгіну жылдамдығы секундына екі немесе одан да көп жүгінуді құрайды;

4.1.2. Бір пайдаланушы тіркелгісінен өтінім беру арасындағы ең аз уақыт аралығы 1,2 секундтан аз;

4.1.3. Өтінім 1,119 секундтан аз уақытта берілген;

4.1.4. Өтінім белгіленген тәртіпті бұза отырып берілген - мұндай өтінімдер автоматты түрде жарамсыз деп танылады және жойылады, ал осы өтінімдер негізінде жасалған мәмілелер күшін жояды.

4.2. ТБЭСЖ-ға 1,119 секунд пен 3 секунд аралығында берілген өтінімдер міндетті түрде мониторингтен өткізіледі, автоматтандырылған беру құралдарын (роботтарды) пайдалануды анықтау мақсатында.

4.3. ТБЭСЖ-ға 3 секунд және одан көп уақытта берілген өтінімдер талаптарға сәйкестігі және автоматтандыру белгілерінің жоқтығы тұрғысынан іріктеп мониторинг жасау шеңберінде талдануы мүмкін.

4.4. ТБЭСЖ-ға берілген өтінімдер төменде көрсетілген бір немесе бірнеше тармақтардағы әрекеттерге сәйкес келмесе:

4.4.1. Механикалық (қолмен) тышқан курсорын жылжыту - курсордың экрандағы орнын физикалық түрде тышқанды (немесе басқа манипуляторды) тек қолмен қозғалту арқылы басқару. Бұл кезде курсор қозғалысының визуалды көрінісінде түзу сызықтар мен тік бұрыштар болмайды;

4.4.2. «Бірлік үшін баға» ұяшығына басу - ұяшық белсендіріледі, курсор пайда болады;

4.4.3. «Бірлік үшін баға» ұяшығына мәнді енгізу немесе қою - енгізілген мәндер көрсетіледі;

4.4.4. «Лоттар саны» немесе «Тауар саны» ұяшығына курсорды апару - ұяшықтың шеңберінде жарықтандыру пайда болады;

4.4.5. «Лоттар саны» немесе «Тауар саны» ұяшығына басу - ұяшық белсендіріледі, курсор пайда болады;

4.4.6. «Лоттар саны» немесе «Тауар саны» ұяшығына мәнді енгізу немесе қою - енгізілген мәндер көрсетіледі. Егер лоттар/тауар саны Сауда департаменті белгілеген шектен асса, лоттар/тауар саны автоматты түрде ең жоғары мәнге өзгереді;

4.4.7. «Баланс» жолындағы қажетті түймеге курсорды апару (қажет болған жағдайда) - белсенді емес түймеде әлсіз жарық пайда болады, белсенді түйменің сыртқы түрі өзгермейді;

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	6-шы бет/ 7 беттен

4.4.8. Түймені басу (қажет болған жағдайда) - белсенді емес түймені басқанда, ол белсенді күйге ауысады, түйменің түсі көкке өзгереді;

4.4.9. «Клиентті таңдау» өрісіне курсорды апару (қажет болған жағдайда) - еш өзгеріс болмайды;

4.4.10. «Клиентті таңдау» өрісін басу (қажет болған жағдайда) - клиенттерді таңдау терезесі ашылады;

4.4.11. Ашылмалы тізімдегі қажетті Клиенттің атауына курсорды апару (қажет болған жағдайда) - еш өзгеріс болмайды;

4.4.12. Клиенттің атауын басу (қажет болған жағдайда) - клиентті таңдау терезесі жабылады, «Клиентті таңдау» өрісінде пайдаланушы таңдаған клиенттің атауы пайда болады;

4.4.13. «Өтінім беру» түймесіне курсорды апару - еш өзгеріс болмайды;

4.4.14. «Өтінім беру» түймесін басу - түйме жарықтанып, өтінім биржалық стаканда пайда болады, өтінім беру терезесі тазартылады - мұндай өтінімдер автоматты түрде жарамсыз деп танылады және жойылады, ал осы өтінімдер негізінде жасалған мәмілелер күшін жояды, себебі олар көрсетілген параметрлерге сәйкес келмейді.

Дилер пайдаланушысынан түскен өтінімдерді 4.4.7 - 4.4.12 тармақтары бойынша мониторинг жасау қолданылмайды.

4.5. ТБЭСЖ-ға кез келген әрекеттер кезінде барлық жүгінулер автоматты түрде тіркеледі.

4.6. Қажет болған жағдайда және өз қалауы бойынша «КТБ» АҚ-ның уәкілетті қызметкерлері кез келген әрекет бойынша, соның ішінде берілген өтінімдердің талаптарға сәйкестігі мен автоматтандыру белгілерінің жоқтығын тексеру мақсатында, ТБЭСЖ-ға жүгінулерді мониторингтен өткізуге құқылы.

4.7. Осы Методологияның 4.2., 4.3., 4.4. тармақтарында сипатталған жағдайларда сауда процесінде Автоматтандыру анықталған кезде, тауарлық биржаның уәкілетті қызметкерлері берілген өтінімдерді жарамсыз деп тану туралы шешім қабылдайды, өтінімдер жойылады, сондай-ақ осы өтінімдер негізінде жасалған мәмілелер күшін жояды.

5. Жауапкершілік және құқықтар

5.1. Дисциплинарлық ықпал ету шаралары «КТБ» АҚ мүшелеріне осы Методологияның 4-бабында сипатталған бұзушылықтар анықталған кезде, тауар биржасының шешімімен (тиісті бұйрық) қолданылады.

5.2. Дисциплинарлық ықпал ету шараларына мыналар жатады:

5.2.1 ескерту;

5.2.2. айыппұл;

5.2.3 белгілі бір уақыт аралығында биржалық саудаға қатысу құқығынан айыру;

	Биржалық саудаға қатысу процесінде автоматтандырылған алгоритмдерді анықтау әдістемесі және «Каспий» тауар биржасы» АҚ-да қабылданатын жауапкершілік шаралары	
	1-ші нұсқа	7-ші бет/ 7 беттен

5.2.4. Тауарлық биржадағы аккредитацияны алты айға дейінгі мерзімге тоқтата тұру;

5.2.5 Биржа мүшесі ретіндегі аккредитацияны тоқтату.

5.3. Дисциплинарлық ықпал ету шаралары “КТБ» АҚ бекіткен «Биржалық сауда ережелерін, “КТБ» АҚ ішкі құжаттарын бұзғаны үшін брокерлерге, дилерлерге қатысты тәртіптік ықпал ету шараларын қолдану қағидалары» талаптарына сәйкес қолданылады.

5.4. “КТБ» АҚ тарапынан сертификатталмаған немесе тыйым салынған бағдарламалық камтамасыз етуді пайдаланатын тауарлық биржа мүшелері осы Методологияға, Биржалық сауда ережелеріне және өзге де биржалық құжаттарға сәйкес жауапкершілікке тартылады.

5.5. Тауарлық биржа мүшелері өздеріне қолданылған айыппұл санкциялары бойынша тауарлық биржаның шешімімен келіспеген жағдайда, “КТБ» АҚ Биржалық төрелігіне жүгінуге құқылы.

5.6. Осы Методологияның 5.5-тармағына сәйкес тауарлық биржа мүшесі биржалық төрелікке жүгінген жағдайда, мұндай мүше аккредитациясының әрекеті биржалық төреліктің шешімі қабылданғанға дейін тоқтатыла тұрады.

5.7. Егер биржалық төрелік мүше қойған талап-арызды қанағаттандырса, тауарлық биржа қабылданған айыппұл санкциясын жояды және аккредитацияны қалпына келтіреді.

5.8. Егер биржалық төрелік мүше қойған талап-арызды қанағаттандырудан бас тартса, тауарлық биржа мұндай мүшенің аккредитациясын алты айға дейінгі мерзімге тоқтата тұруға құқылы.

6. Қорытынды ережелер

6.1. Осы Методология нормативтік-құқықтық базаның өзгеруіне, жаңа технологиялық шешімдердің пайда болуына және/немесе қолданыстағы бақылау рәсімдеріндегі олқылықтардың анықталуына байланысты қайта қаралуы және өзектендірілуі тиіс.

6.2. Саудаға қатысушылар осы Методологиямен танысуға және оның ережелерін сақтау үшін белгіленген нормаларға сәйкес жауапкершілікке ие.

6.3. Методология тауарлық биржа шешімімен бекітілген сәттен бастап күшіне енеді және “КТБ» АҚ-ның барлық мүшелері үшін міндетті болып табылады.