

«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:

<b>Администратор -</b>	штатный работник Биржи, уполномоченный на выполнение функций администрирования Торговой системы.
<b>Биржа -</b>	Акционерное общество «Товарная биржа «Евразийская Торговая Система».
<b>Департамент торгов -</b>	структурное подразделение Биржи, ответственное за сопровождение аккредитованных брокеров, дилеров по их участию в биржевых торгах на торговых секциях Биржи.
<b>Заявка на продажу (покупку) Товара/Заявка -</b>	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.
<b>Клиринговый центр -</b>	Товарищество с ограниченной ответственностью «Клиринговый центр ЕТС»

<b>Правила биржевой торговли</b>	действующие Правила биржевой торговли, утвержденные уполномоченным государственным органом Республики Казахстан в сфере регулирования биржевого товарного рынка страны, и размещенные на интернет-ресурсе Биржи: <a href="http://www.ets.kz">www.ets.kz</a>
<b>Рабочая станция -</b>	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.
<b>Сделка -</b>	биржевая сделка, заключенная в Торговой системе на основании объявленных сторонами сделки Заявок.
<b>Торговые роботы</b>	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.
<b>Торги -</b>	процесс, проводимый в рамках Правил биржевой торговли, направленный на совершение сделок с Товаром на основе заявок, поданных в Торговую систему.
<b>Торговая система -</b>	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.
<b>Участник торгов -</b>	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.** В соответствии с требованиями Правил биржевой торговли, членам Биржи запрещено использование технологий 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.

Сделки, заключенные с использованием подобных технологий, признаются недействительными и подлежат отмене Биржей.

**1.3.** Автоматизированные программно-технические средства сбора, подготовки заявок к вводу и направления заявок в торговую систему, а также получение и обработка информации из торговой системы, работающей в режиме, обеспечивающем контроль со стороны членов Биржи за всеми действиями, совершаемыми с ее использованием, сертифицируются решением Биржи.

**1.4.** Сделки, заключенные участниками торгов с использованием подобных программно-технических средств, не сертифицированных Биржей, признаются недействительными и подлежат отмене Биржей.

## **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 1.96.1.16.

**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 недействительными и подлежащими отмене согласно требованиям Правил биржевой торговли.

**3.3.** На основании данной служебной записки Правлением Биржи выносится решение об отмене признанных недействительными 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 недействительности 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.