

Приложение 2

УТВЕРЖДЕНЫ
приказом НКО НКЦ (АО)
от «22» февраля 2019 года
№ 01-01/24

Требования к оформлению сообщений при подаче Предложений Участником клиринга на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой посредством системы передачи информации Bloomberg

Раздел 1. Общие положения

1. Заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой Участниками клиринга, использующими для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место Bloomberg, осуществляется путем подачи текстовых сообщений в соответствии с настоящими Требованиями.
2. ПАО Московская Биржа, являясь Техническим центром, осуществляет процедуру аутентификации в отношении текстовых сообщений Участника клиринга, использующего для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место Bloomberg, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга, осуществляет трансляцию текстовых сообщений в Клиринговую систему в виде Предложений, а также направляет в Клиринговую систему иные сообщения, предусмотренные настоящими Требованиями.
3. Для подачи в Клиринговую систему Участником клиринга Предложений на заключение Внебиржевых сделок посредством системы передачи информации Bloomberg используется код MICX – код ПАО Московская Биржа в системе «Bloomberg Professional».
4. Для заключения Внебиржевых сделок Участник клиринга письменно сообщает Техническому центру уникальный символьный код, закрепленный за Участником клиринга в системе передачи информации «Bloomberg Professional», для использования при аутентификации Участника клиринга.
5. Участники клиринга несут полную ответственность за подаваемые с использованием Рабочего места Bloomberg Предложения на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой.
6. Подтверждением подачи Предложения на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой с использованием Рабочего места Bloomberg является протокол, в котором содержится не требующее дополнительного подтверждения волеизъявление Участника клиринга на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой в соответствии с Правилами клиринга, а также настоящими Требованиями.

7. Термины, специально не определенные в настоящих Требованиях, используются в значениях, установленных в Правилах клиринга.

Раздел 2. Используемые обозначения

1. В одинарных угловых скобках < > указываются следующие обозначения:
 - <сумма> – сумма в единицах иностранной валюты, при указании которой дополнительно могут использоваться следующие общепринятые сокращения: **K**, **T**, **TH** – тысяч, **M**, **MIO** – миллионов, **YRD**, **YARD** – миллиардов;
 - <инструмент> – установленное обозначение кода Внебиржевой сделки в Клиринговой системе (далее – КС); при работе в КС инструмент может обозначаться как пара валют (<валюта1> **AG** <валюта2>) с последующим указанием даты валютирования, например: 16APR2019;
 - <макс. курс покупки>, <мин. курс продажи> – курсы указанного инструмента, указываемые в формате, используемом при заключении Внебиржевых сделок.
2. В фигурные скобки { } заключены необязательные ключевые слова и обозначения, которые могут быть опущены без потери смысла всего выражения.
3. В круглые скобки () заключено альтернативное ключевое слово, которое может быть использовано вместо ключевого слова, стоящего перед ним.

Раздел 3. Порядок обмена текстовыми сообщениями между НКЦ и Участниками клиринга при заключении Внебиржевых сделок в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов с использованием РМ БЛУМБЕРГ

Обмен сообщениями при заключении Внебиржевых сделок на валютном рынке и рынке драгоценных металлов может осуществляться следующими способами.

1. Вариант 1

Подача Предложений Участников клиринга на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой осуществляется путем трансляции в КС в виде Предложений одного из текстовых сообщений, переданных Участником клиринга в форматах, приведённых в п.п. 3.1 – 3.2, 3.6 – 3.7 настоящего Раздела.

- 1.1 Проверка статуса (состояния) зарегистрированных в КС Предложений Участника клиринга осуществляется путем передачи Участником клиринга в НКЦ одного из текстовых сообщений в форматах, приведённых в п.п. 3.3 – 3.4 настоящего Раздела.
- 1.2 Передача каждого текстового сообщения в ходе обмена сообщениями между НКЦ и Участниками клиринга завершается нажатием кнопки **TRANSMIT**.
- 1.3 Подтверждение трансляции в КС текстовых сообщений Участников клиринга в виде Предложений осуществляется путем направления текстового сообщения в формате, приведённом в п.п.4.1 настоящего Раздела.
- 1.4 Отклонение требований на ввод Участником клиринга Предложений осуществляется путем направления одного из текстовых сообщений в форматах, приведённых в п.п. 4.6 – 4.11 настоящего Раздела.
- 1.5 О заключении (незаключении) Внебиржевой сделки на основании Предложения, поданного Участником клиринга, НКЦ посредством Технического центра уведомляет такого Участника клиринга с использованием текстовых сообщений в

- форматах, приведённых в п.п. 4.4, 4.5 настоящего Раздела.
- 1.6 В случае возникновения вынужденной задержки в обмене текстовыми сообщениями НКЦ или Участник клиринга через Технический центр могут запросить ожидание путем направления текстового сообщения в форматах, приведённых в п.п. 3.9, 4.12 настоящего Раздела.

2. Вариант 2.

- 2.1 Участник клиринга требует проинформировать о котировках Провайдеров ликвидности, содержащихся в КС, путем направления текстового сообщения в формате, приведённом в п.п. 3.5 настоящего Раздела.
- 2.2 НКЦ информирует Участника клиринга о наличии текущих котировок Провайдеров ликвидности путем направления одного из текстовых сообщений в форматах, приведённых в п.п. 4.2 – 4.3 настоящего Раздела.
- 2.3 Участник клиринга передает НКЦ одно из текстовых сообщений в форматах, приведённых в п.п. 3.6 – 3.7 настоящего Раздела, для их последующей трансляции в КС.
- 2.4 После трансляции в КС полученного от Участника клиринга текстового сообщения в виде Предложения НКЦ посредством Технического центра уведомляет Участника клиринга о результате операции путем направления одного из текстовых сообщений в форматах, приведённых в п.п. 4.1 – 4.5 настоящего Раздела.
- 2.5 В случае неисполнения поданного Предложения, данное Предложение снимается автоматически.
- 2.6 В случае возникновения вынужденной задержки в обмене текстовыми сообщениями НКЦ или Участник клиринга через Технический центр могут запросить ожидание путем направления текстового сообщения в форматах, приведённых в п.п. 3.9, 4.12 настоящего Раздела.

3. Форматы текстовых сообщений, направляемых Участниками клиринга при заключении Внебиржевых сделок:

3.1 «{I NEED TO} BUY (BID) <сумма> <инструмент> {AT} <макс. курс покупки> OTC»

Требование на ввод лимитированного по курсу <макс. курс покупки> Предложения на покупку по инструменту <инструмент> в объёме <сумма>;

3.2 «{I NEED TO} SELL (OFR) <сумма> <инструмент> {AT} <мин. курс продажи> OTC»

Требование на ввод лимитированного по курсу <мин. курс продажи> Предложения на продажу по инструменту <инструмент> в объёме <сумма>;

3.3 «STATUS BID <инструмент> {<сумма>} {AT} <макс. курс покупки>»

Запрос о состоянии (статусе) лимитированного по курсу <макс. курс покупки> Предложения на покупку по инструменту <инструмент> в объёме <сумма>;

3.4 «STATUS OFR <инструмент> {<сумма>} {AT} <мин. курс продажи>»

Запрос о состоянии (статусе) лимитированного по курсу <мин. курс продажи> Предложения на продажу по инструменту <инструмент> в объёме <сумма>;

3.5 «<сумма> <инструмент>»

Требование сообщить Участнику клиринга максимальный курс покупки и минимальный курс продажи по инструменту <инструмент> на основе текущих котировок Провайдеров ликвидности в КС с объёмом <сумма>;

3.6 «BUY OTC»

Требование Участника клиринга на ввод лимитированного Предложения на покупку по инструменту и в объёме, ранее указанном в запросе данного Участника клиринга, по минимальному курсу продажи;

3.7 «SELL OTC»

Требование Участника клиринга на ввод лимитированного Предложения на продажу по инструменту и в объёме, ранее указанном в запросе данного Участника клиринга, по максимальному курсу покупки;

3.8 «NET <инструмент>»*

Запрос о значении текущей нетто позиции Участника клиринга по инструменту <инструмент>; запрос о значении итоговых нетто-требований и нетто-обязательств Участника на дату завершения торговой сессии с указанием суммы комиссионного вознаграждения и величины уплачиваемого НДС;

3.9 «MOM PL»

Запрос ожидания.

4. Форматы текстовых сообщений, направляемых посредством Технического центра по результатам обработки текстовых сообщений, поступивших от Участника клиринга:

4.1 «ACCEPTED {<инструмент> BID (OFFER)}»

Подтверждение ввода в КС Предложения на покупку (продажу) по инструменту <инструмент>;

4.2 «{<инструмент>} <макс. курс покупки> <мин. курс продажи>»

Сообщение, уведомляющее Участника клиринга о наличии в КС текущих котировок Провайдеров ликвидности, одной из которых является котировка на покупку – <макс. курс покупки>, а другой – котировка на продажу – <мин. курс продажи> по инструменту <инструмент> с объёмом, указанным в запросе данного Участника клиринга, либо разницу между ценой покупки/продажи на объем (спред);

4.3 «SRY NOTHING TO SUGGEST»

Сообщение, уведомляющее Участника клиринга об отсутствии в КС текущих котировок Провайдеров ликвидности, удовлетворяющих зарегистрированному в КС Предложению, по инструменту и в объёме, указанном в запросе данного Участника клиринга;

4.4 «DONE <сумма> <инструмента> {AT} <курс сделки>»

Сообщение о заключении данным Участником клиринга Внебиржевой сделки по инструменту <инструмент> в объёме <сумма> по курсу <курс сделки>;

4.5 «NOTHING DONE»

Сообщение о невозможности заключения Внебиржевой сделки по причине отсутствия в КС котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей зарегистрированному в Клиринговой системе Предложению, поданному Участником клиринга;

4.6 «ACCESS TO OTC TRADES DENIED»

Сообщение об отсутствии допуска к заключению Внебиржевых сделок;

4.7 «OVER LINE ON <валюта>»

* -справочно

Сообщение об отклонении Предложения по причине недостаточности Единого лимита Участника клиринга по валюте <валюта>;

4.8 «OVER RATE»

Сообщение об отклонении Предложения по причине превышения указанным в данном Предложении курсом установленных для инструмента значений ценового коридора;

4.9 «CHECK ORDER»

Сообщение с требованием уточнить смысл Предложения по причине ошибки в ключевом слове или по причине несоответствия формы Предложения требованиям настоящих Требований;

4.10 «CHECK RATE»

Сообщение с требованием проверить (исправить) курс, указанный в Предложении Участника клиринга;

4.11 «CHECK AMNT»

Сообщение с требованием проверить (исправить) сумму, указанную в Предложении Участника клиринга;

4.12 «MOM PL»

Запрос ожидания.

Раздел 4. Доступные сокращения в текстовых сообщениях при подаче/приеме Предложений на покупку (продажу) иностранной валюты/драгоценного металла на торгах на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

№	Что нужно написать	Возможные варианты написания
---	--------------------	------------------------------

Команды, относящиеся к заключению Внебиржевых сделок

1.	BUY	BUY, I BUY, BID
2.	SELL	SELL, I SELL, OFFER, OFER, OFFR, OFR
3.	STATUS	STATUS, STAT
4.	NET	NET, NETT, NETTING

Инструменты

№	Инструмент	Что нужно написать	Возможные варианты написания
5.	EURUSD_SPT	EURUSDSPT	EURUSDSPT,EURUSD SPT, EUR USD SPT, EUR\$SPT, EUR\$ SPT, EUR \$ SPT
6.	GBPUSD_SPT	GBPUSDSPT	GBPUSDSPT,GBPUSD SPT, GBP USD SPT, GBP\$SPT, GBP\$ SPT, GBP \$ SPT
7.	USDCNY_SPT	USDCNYSPT	USDCNYSPT, USDCNY SPT, USD CNY SPT, \$CNYSPT, \$CNY SPT, \$ CNY SPT
8.	USDTRY_TOM	USDTRYTOM	USDTRYTOM, USDTRY TOM, USD TRY TOM, \$TRYTOM, \$TRY TOM, \$ TRY TOM

Прощито, пронумеровано и скреплено печатью
5 (Хавин) лист 06

Председатель Правления НКО НКЦ (АО)

А.С. Хавин
20.02.2019 г.

