

Приложение 1

УТВЕРЖДЕНЫ

приказом НКО НКЦ (АО)

от «25» июля 2019 года

№ 01-01/125

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

Раздел 1. Общие положения

1. Заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой Участниками клиринга, использующими для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место Рейтер, 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 Рейтер, 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 Рейтер используется код MICX – код ПАО Московская Биржа в системе «Рейтер – Дилинг».
4. Для заключения Внебиржевых сделок Участник клиринга письменно сообщает Техническому центру уникальный символьный код, закрепленный за Участником клиринга в системе передачи информации «Рейтер – Дилинг», для использования при аутентификации Участника клиринга.
5. Участники клиринга несут полную ответственность за подаваемые с использованием Рабочего места Рейтер Предложения на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой.
6. Подтверждением подачи Предложения на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой с использованием Рабочего места Рейтер 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 РЕЙТЕР

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 объеме <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 объеме <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 объеме <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 объеме <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 объемом <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	<i>BUY, I BUY, BID</i>	
2.	SELL	<i>SELL, I SELL, OFFER, OFER, OFFR, OFR</i>	
3.	STATUS	<i>STATUS, STAT</i>	
4.	NET	<i>NET, NETT, NETTING</i>	
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
9.	USDJPY_SPT	USDJPYSPT	USDJPYSPT, USDJPY SPT, USD JPY SPT, \$JPYSPT, \$JPY SPT, \$ JPY SPT