

Приложение 2

УТВЕРЖДЕНЫ

приказом НКО НКЦ (АО)

от « 11 » февраля 2020 года

№ 01-01/30

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

Раздел 1. Общие положения

1. Заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой Участниками клиринга, использующими для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место Блумберг, 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 Блумберг, 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 Блумберг 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 Блумберг Предложения на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой.
6. Подтверждением подачи Предложения на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой с использованием Рабочего места Блумберг 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> ОТСТ (OTCF)**»

Требование на ввод лимитированного по курсу <макс. курс покупки> Предложения на покупку по инструменту <инструмент> в объёме <сумма> в режиме ОТСТ (или в режиме OTCF);

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

Требование на ввод лимитированного по курсу <мин. курс продажи> Предложения на продажу по инструменту <инструмент> в объёме <сумма> в режиме ОТСТ (или в режиме OTCF);

- 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 объемом *<сумма>*;

3.6 «BUY ОТСТ (OTCF)»

Требование Участника клиринга на ввод лимитированного Предложения на покупку по инструменту и в объеме, ранее указанном в запросе данного Участника клиринга, по минимальному курсу продажи в режиме ОТСТ (или в режиме OTCF);

3.7 «SELL ОТСТ (OTCF)»

Требование Участника клиринга на ввод лимитированного Предложения на продажу по инструменту и в объеме, ранее указанном в запросе данного Участника клиринга, по максимальному курсу покупки в режиме ОТСТ (или в режиме OTCF);

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 объемом, 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 объеме, 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 объеме *<сумма>* по курсу *<курс сделки>*;

4.5 «NOTHING DONE»

Сообщение о невозможности заключения Внебиржевой сделки по причине отсутствия в КС котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей

* - справочно.

зарегистрированному в Клиринговой системе Предложению, поданному Участником клиринга;

- 4.6 **«ACCESS TO OTCT (OTCF) TRADES DENIED»**
Сообщение об отсутствии допуска к заключению Внебиржевых сделок в режиме OTCT (OTCF);
- 4.7 **«OVER SINGLE LIMIT»**
Сообщение об отклонении Предложения по причине недостаточности Единого лимита Участника клиринга;
- 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