

СПОНСИРУЕМЫЙ ДОСТУП К МОСКОВСКОЙ БИРЖЕ

Москва, 2017

ОГЛАВЛЕНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	2
ТЕРМИНОЛОГИЯ	2
ДОКУМЕНТЫ	3
ПОРЯДОК ОБРАБОТКИ ПОРУЧЕНИЙ С SMA_ID	3
ФУНКЦИОНАЛ CANCEL ON DISCONNECT	3
ФУНКЦИОНАЛ PRE-TRADE КОНТРОЛЯ	4
ИНТЕРФЕЙСЫ ПОДКЛЮЧЕНИЯ К ТКС	4
ОРГАНИЗАЦИЯ СЕТЕВОГО ПОДКЛЮЧЕНИЯ	4
ПОРЯДОК ПОДКЛЮЧЕНИЯ КЛИЕНТА	5
ПОРЯДОК ТЕСТИРОВАНИЯ И СЕРТИФИКАЦИИ ПО	5
ПОРЯДОК ОБРАБОТКИ ОБРАЩЕНИЙ КЛИЕНТА	6
КОНТАКТЫ	6
ПРИЛОЖЕНИЕ 1. СПИСОК ПАРАМЕТРОВ PRE-TRADE КОНТРОЛЯ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ	7



ВВЕДЕНИЕ

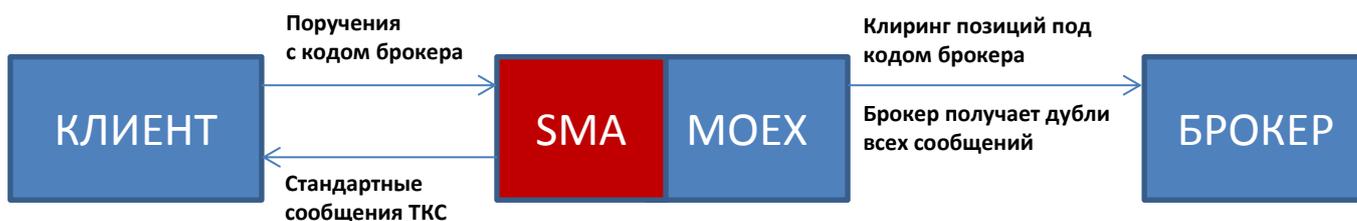
Спонсируемый доступ – это способ предоставления клиентам Участников торгов технического доступа к соответствующим подсистемам торгово-клиринговой системы (далее - ТКС) ПАО Московская Биржа (далее - Биржа), с помощью которого клиент может подавать поручения Участнику торгов ("спонсирующей" фирме) для исполнения на рынке путем постановки заявок напрямую в ТКС.

В целях организации подачи заявок Участником торгов по поручениям Клиентов Биржа предоставляет Участникам торгов соответствующие средства управления риском, чтобы не допустить попадания ошибочных заявок в торговую систему.

Данный документ описывает функциональные возможности организации Спонсируемого доступа, а также порядок и способ его предоставления.

Нормативная документация, регулирующая предоставление Спонсируемого доступа, размещена на сайте ПАО Московская Биржа – moex.com, а также cbr.ru (Положение ЦБ РФ № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов»).

Настоящее руководство описывает Спонсируемый доступ на Валютном и Фондовом рынках Московской Биржи. По мере внедрения сервиса на остальных рынках, данный материал подлежит обновлению.



ТЕРМИНОЛОГИЯ

Участник торгов (Участник) – организация, допущенная к организованным торгам после выполнения установленных Биржей условий допуска.

Клиент Участника (Клиент) – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в соответствии с Правилами допуска к участию в торгах на рынках ПАО Московская Биржа, по поручению которого Участник торгов подает заявки в ТКС с целью заключения сделок в соответствии с Правилами торгов соответствующего рынка.

Поручение – электронное сообщение, подписанное АСП Клиента Участника и поручающее Участнику совершить на Бирже то или иное действие.

Заявка (торговый приказ) – электронное сообщение, подписанное АСП Участника и являющееся предложением для других Участников торгов совершить ту или иную сделку.

SMA_ID – идентификатор (user_id), с помощью которого Клиент Участника идентифицируется в Торговой системе и от имени которого присылает поручения.

MASTER_ID – идентификатор Участника, с помощью которого Участник подключается к Торговой системе, выставляет заявки, контролирует исполнение заявок.

Участник вправе использовать один MASTER_ID для более чем одного SMA_ID.

ДОКУМЕНТЫ

Участнику

Предоставление Спонсируемого доступа осуществляется Биржей на основании Правил торгов и соответствующих договоров о предоставлении интегрированного технологического сервиса, заключенных между Биржей и Участниками торгов.

Формы заявлений Участника для организации Спонсируемого доступа размещаются на сайте Биржи по адресу: <http://moex.com/a1819>.

Участник торгов несёт полную ответственность за всю торговую активность, осуществляемую в рамках предоставления Клиенту Спонсируемого доступа.

Клиенту Участника

Сервисы технологического подключения к инфраструктуре Биржи для подачи поручений Клиентом Участника торгов могут быть предоставлены Клиенту на основании соответствующих договоров, заключенных между Клиентом и Техническим центром.

Предоставление технического доступа Клиенту к подсистеме обработки поручений с использованием SMA_ID осуществляется Участником торгов на основании соответствующего договора, заключённого между Участником торгов и Клиентом.

Предоставление права использования Биржевой информации Клиентом в рамках предоставления Спонсируемого доступа, в зависимости от способа её использования, осуществляется Биржей на основании соответствующих договоров, заключенных между Биржей и Участником торгов, и/или Биржей и Клиентом.

ПОРЯДОК ОБРАБОТКИ ПОРУЧЕНИЙ С SMA_ID

Клиент Участника осуществляет подключение к подсистеме обработки поручений ТКС, используя полученный от Участника торгов SMA_ID. Клиент отправляет в ТКС поручения, подписанные его SMA_ID.

При получении поручения от Клиента, с помощью функционала Спонсируемого доступа, встроенного в ТКС, проверяется:

1. Соответствие поручения базовым параметрам риска ТКС.
2. Наличие активного соединения Участника торгов (MASTER_ID, связанного с SMA_ID).
3. Соответствие поручения установленным Участником торгов ограничениям pre-trade контроля.

ФУНКЦИОНАЛ CANCEL ON DISCONNECT

Для обеспечения возможности автоматического снятия заявок Клиентов при достижении временного порога неактивности, отключении или потере соединения с ТКС Биржи, в ТКС добавлена функциональная возможность [Cancel On Disconnect](#). Для подключения функционала Участнику необходимо подать соответствующее распоряжение через Клиентский Центр. В случае

активированного функционала Cancel On Disconnect для SMA_ID при подключении Клиента к ТКС активируется режим контроля за состоянием подключения (COD-режим).

При активном COD-режиме заявки спонсируемого клиента снимаются ТКС Биржи в следующих случаях:

- при выходе (дерегистрации) SMA_ID из ТКС;
- при выходе (дерегистрации) связанного MASTER_ID из ТКС;
- при отправке команды [USER TRADE SUSP](#) с пометкой «Снятие заявок» Участником торгов;
- при достижении порога транзакционной неактивности подключения.

Для создания транзакционной активности при отсутствии торговой активности приложению Клиента необходимо с периодичностью посылать в ТКС специальное сообщение (Heartbeat).

Подробное описание порядка проверки работоспособности приложений, а также требования к клиентским приложениям размещены по [ссылке](#).

ФУНКЦИОНАЛ PRE-TRADE КОНТРОЛЯ

Участник торгов вправе установить дополнительные параметры (ограничения) для проверки поручений спонсируемого клиента в подсистеме обработки поручений. Данные параметры устанавливаются при помощи API [ASTS Bridge](#) (а также использующих его торговых терминалов, в т.ч. [MICEX Trade SE](#)), а также [Личного кабинета Участника](#) (ЛКУ). Ограничения устанавливаются индивидуально для каждого SMA_ID.

Поданные SMA_ID поручения отклоняются подсистемой обработки поручений, если не выполняются условия хотя бы одной проверки, установленной Участником торгов. Перечень параметров pre-trade контроля на Фондовом рынке доступен в [Приложении 1](#) данного документа.

ИНТЕРФЕЙСЫ ПОДКЛЮЧЕНИЯ К ТКС

Отправка поручений в ТКС:

Доступны подключения как с помощью полнофункционального API ([ASTS Bridge](#), в т.ч. Биржевых терминалов и продуктов, его использующих), так и стандартного протокола [FIX](#).

Получение Биржевой информации:

Возможно как по стандартному [протоколу FAST](#) в режиме реального времени, так и с помощью полнофункционального API.

ОРГАНИЗАЦИЯ СЕТЕВОГО ПОДКЛЮЧЕНИЯ

Сетевое подключение Клиента к ТКС в рамках предоставления Спонсируемого доступа может быть организовано одним из следующих способов:

1. [Размещение оборудования в ЦОД Биржи \(колокация\)](#).
2. [Подключение через международные точки присутствия Биржи \(POP\)](#).
3. [Услуга ConnectME](#).
4. [Универсальная схема подключения](#).
5. [Интернет](#).

ПОРЯДОК ПОДКЛЮЧЕНИЯ КЛИЕНТА

1. Клиент получает ПО, необходимое для организации потока поручений в подсистему ТКС Биржи у Участника торгов на праве сублицензии либо услугу, предоставляемую ему Участником торгов в соответствии с его правами, регулируемые соответствующими договорами и иными нормативными документами организатора торговли.
2. При необходимости получения Биржевой информации, Клиент должен заключить необходимый договор с ПАО Московская Биржа.
Контакты: Управление продаж Биржевой информации по тел.: +7(495) 363-3232, или по адресу data@moex.com.
3. В отделе продвижения технологических продуктов и услуг (тел.: +7(495) 363-3232, доб. 10100 или e-mail: mbt@moex.com) Клиент заказывает услугу сетевого подключения по одной из 5 схем, описанных выше, а также, в случае необходимости, техническую услугу предоставления доступа к Биржевой информации по протоколу FAST.
4. В случае организации выделенного канала до ЦОД Биржи, Клиент приобретает оборудование, соответствующее [требованиям](#), и заказывает каналы связи у [оператора\(-ов\), авторизованных Биржей](#).
5. При поддержке специалистов Биржи и оператора производится необходимая коммутация оборудования и выделяется пул IP адресов в Биржевом сегменте. Пожалуйста, обратите внимание, что предоставление выделенных каналов связи в состав услуг Биржи не входит и оплачивается дополнительно оператору связи.
6. Проводится тестирование доступности Layer 1 сервиса.
7. В случае успешного тестирования специалисты Биржи и оператора производят необходимую настройку конфигурации оборудования.
8. Клиент (или разработчик ПО) проходит процедуру сертификации ПО, подключающегося к торговой системе. Если ПО было ранее сертифицировано Биржей, но не сертифицирован функционал SMA, необходима повторная сертификация.
9. Представители Биржи и Клиент завершают подписание договоров на ИТ-услуги и Биржевую информацию.
10. Клиент переключает систему в «боевой» режим.

ПОРЯДОК ТЕСТИРОВАНИЯ И СЕРТИФИКАЦИИ ПО

Цель процесса сертификации – выявление технических ошибок реализации подключения клиентского приложения к Бирже для минимизации потенциального ущерба ТКС и другим Участникам торгов и их Клиентам от некорректной работы внешних систем.

Сертификация является обязательной процедурой для подключения ПО к ТКС Биржи. В случае, если система с поддержкой Спонсируемого доступа была ранее сертифицирована Биржей, повторная сертификация не требуется.

Для прохождения сертификации ПО необходимо получить доступ к тестовому контуру, обслуживающего тот рынок, для которого проводится сертификация.

Для подключения к тестовой среде Биржи необходимо заполнить анкету по ссылке: <http://moex.com/ru/forms/poll/questionnaire.aspx?id=03>.

В течение 2-3 дней специалисты Биржи присваивают тестовые идентификаторы и выдают настройки подключения.

После успешного тестирования системы для запуска процедуры сертификации разработчику системы или клиенту, если он разрабатывает систему самостоятельно, необходимо направить запрос в свободной форме по адресу help@moex.com.

Основные положения сертификации:

1. Биржа устанавливает сценарии тестов при сертификации и требования к результатам тестов для каждого из рынков/типов подключения.
2. Биржа устанавливает требования к минимальному функционалу клиентских систем.
3. Биржа вправе внедрить логический функционал, при добавлении которого разработчик обязан пересертифицировать уже работающее ПО.
4. Биржа обязуется при выдаче функционала в публичный тест указывать необходимость пересертификации ПО, использующего данный функционал. Если такого указания нет, то при добавлении данного функционала в ВПТС пересертификация не требуется.
5. Биржа вправе отключить ВПТС от ТКС, если считает, что она вредит другим Участникам торгов и/или их Клиентам или Бирже.
6. Биржа может потребовать проведения повторной сертификации системы в случае, если зафиксировано использование несертифицированного функционала (т.е. не заявленного изначально функционала или нового функционала, отмеченного биржей, как требующего пересертификации) либо производилось принудительное отключение системы согласно предыдущему пункту.
7. Сертифицируется конкретная версия ПО. Изменения, вносимые разработчиком в субверсии этой версии, по умолчанию считаются сертифицированными, если разработчик не настаивает на добровольной повторной пересертификации.
8. Биржа предлагает сценарии тестов подключения внешних систем к системам SPECTRA и ASTS; данные сценарии составлены для проверки правильности использования функций работы с ТКС.
9. Успешное прохождение процедуры сертификации не является гарантией корректной работы аппаратно-вычислительного комплекса брокера. Помимо процедуры сертификации приложения при подключении к Бирже внешние системы должны соблюдать рекомендации по оборудованию и каналам связи, специфические для каждого вида физического подключения, а также удовлетворять Требованиям, предъявляемым Московской Биржей к ВПТС и порядку их сопряжения с программно-техническим комплексом биржи.
10. В случае несоответствия представленной на сертификацию ВПТС требованиям, предъявляемым к ВПТС, либо иным пунктам настоящего Положения Биржа оставляет за собой право отказать в сертификации такой ВПТС.

[Подробная информация о порядке сертификации](#)
[Требования к сопряжению ВПТС с ПТК ТЦ](#)

После успешного прохождения сертификации система Клиента может подключаться к ТКС для отправки торговых поручений.

ПОРЯДОК ОБРАБОТКИ ОБРАЩЕНИЙ КЛИЕНТА

Приём обращений от Клиентов производится по электронной почте (help@moex.com) и по телефону (+7-495-733-9507). Обработка входящих обращений по электронной почте и по телефону осуществляется специалистами Биржи по будням с 08:00 до 24:00 MSK.

КОНТАКТЫ

Со всеми вопросами, пожалуйста, обращайтесь:

Отдел продаж:

Т +7 (495) 363-3232, доб. 10100

Е mbt@moex.com

Техническая поддержка:

Т +7 (495) 733-9507

Е help@moex.com

ПРИЛОЖЕНИЕ 1. СПИСОК ПАРАМЕТРОВ PRE-TRADE КОНТРОЛЯ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ

	Проверяемый параметр	Область действия	Установка через
1.	Отклонение цены в заявке от текущей цены (устанавливается допустимое отклонение вверх и вниз)	SMA_ID и/или SMA_ID – SECID	ASTS Bridge, MICEX Trade SE, ЛКУ
2.	Максимальный объем заявки в ценных бумагах		
3.	Максимальный объем заявки в рублях		
4.	Максимальный объем заявок за торговую сессию		
5.	Максимальный объем рыночной заявки в рублях		
6.	Список разрешенных режимов торгов (BOARID)		
7.	Список разрешенных ценных бумаг (SECID)	SMA_ID	ЛКУ
8.	Максимальное количество транзакций в секунду		
9.	Максимальная позиция в ценных бумагах (накопленная за торговую сессию)	SMA_ID – SECID – ТКС	ASTS Bridge, MICEX Trade SE, ЛКУ
10.	Максимальная позиция в рублях (накопленная за торговую сессию)	SMA_ID – ТКС	

Примечания:

1. При установке параметра через API ASTS Bridge или терминал изменения вступают в силу в режиме он-лайн. При установке параметра через ЛКУ изменения вступают в силу на следующий торговый день. Если в ходе торгового дня параметры дополнительных проверок устанавливались и через API ASTS Bridge/терминал MICEX Trade SE, и через ЛКУ, то на следующий день параметры Pre-trade контроля будут соответствовать последним значениям, установленным через ЛКУ.
2. Если установлены ограничения и по SMA_ID, и по паре SMA_ID – SECID, то выполняются оба ограничения (фактически, проверка происходит по более «жесткому» ограничению).
3. В случае отклонения поручения уведомление, направляемое в адрес SMA_ID, будет содержать код ошибки, соответствующий условному номеру непройденной проверки, в результате которой поручение отклоняется.