

**УТВЕРЖДЕНЫ**  
Правлением ЗАО ММВБ  
18 сентября 2009 г.  
(Протокол № 84)

Президент ЗАО ММВБ

\_\_\_\_\_ К.Н.Корищенко

**ТРЕБОВАНИЯ,  
предъявляемые Московской межбанковской валютной биржей (ММВБ)  
к внешним программно-техническим средствам (ВПТС) и порядку их  
сопряжения с Программно-техническим комплексом (ПТК) ММВБ**

**1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

1.1. В целях настоящих Требований используются следующие термины:

- 1) ММВБ – Закрытое акционерное общество «Московская межбанковская валютная биржа»;
- 2) ФБ ММВБ – Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ»;
- 3) НКЦ – Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество);
- 4) НТБ – Закрытое акционерное общество «Национальная товарная биржа»;
- 5) ПТК – Программно-технический комплекс ЗАО ММВБ;
- 6) ВПТС – автоматизированные программно-технические средства сбора, подготовки заявок к вводу и направления заявок в следующие Подсистемы ПТК ММВБ: «Система торгов ЗАО «ФБ ММВБ», «Система клиринга ЗАО ММВБ», «Система электронных торгов ММВБ по сделкам с государственными ценными бумагами», «Система электронных торгов ЗАО ММВБ по заключению сделок с Банком России при проведении Банком России депозитных и кредитных операций (СДКО)», «Система электронных торгов (СЭЛТ)», «Система торговли, клиринга и расчётов по фьючерсам и опционам (СТФО)», «Система торговли, клиринга и расчетов по фьючерсам и опционам на зерно (СТФЗ)» (далее - Подсистемы ПТК), а также получения и обработки информации из Подсистем ПТК, работающие в режиме, обеспечивающем контроль со стороны Пользователя ВПТС за всеми действиями, совершаемыми с ее использованием;
- 7) Пользователь ВПТС (далее - Пользователь) – юридическое лицо, которому ММВБ оказывает услуги на основании заключенных между ММВБ и этим юридическим лицом договора о предоставлении интегрированного технологического сервиса (ИТС) и/или договора об обеспечении технического доступа к ПТК (далее – договор, регламентирующий осуществление технического доступа к ПТК), а также который приобрел или получил право пользования универсальным аппаратно-программным шлюзом (шлюзами), обеспечивающим возможность сопряжения ВПТС с ПТК.
- 8) Правила совершения операций - правила проведения торгов и/или правила проведения клиринга (расчетов) и/или иные внутренние документы организатора

торговли и/или клиринговой организации, определяющие порядок подачи заявок, совершения сделок, осуществления клиринга и расчетов по совершенным сделкам.

1.2. Все иные термины и определения, используемые в настоящих Требованиях, применяются в том смысле, в котором они установлены внутренними документами ММВБ, определяющими порядок осуществления технического доступа к ПТК, и договорными отношениями ММВБ с Пользователями.

1.3. В случае принятия ММВБ решения о соответствии ВПТС настоящим Требованиям, ВПТС подлежит включению в Список ВПТС, соответствующих требованиям ММВБ при сопряжении с ПТК, который в письменной форме доводится до сведения Пользователя.

1.4. Изменения и дополнения в настоящие Требования, утверждаются Правлением ММВБ. Обо всех изменениях и дополнениях в настоящие Требования Пользователи извещаются путем размещения соответствующей информации на сайте ЗАО ММВБ в сети Интернет не позднее, чем за 30 (тридцать) рабочих дней до дня введения в действие данных изменений и дополнений, если иной порядок не предусмотрен решением Правления ММВБ.

## **2. ТРЕБОВАНИЯ К ВПТС ДЛЯ ИХ ВКЛЮЧЕНИЯ В СПИСОК ВПТС**

2.1. Сопряжение с ПТК и обмен данными между ВПТС и Подсистемой (Подсистемами) ПТК должны осуществляться через универсальный аппаратно-программный шлюз (или аппаратно-программные шлюзы) в соответствии с требованиями, отраженными в специальном Приложении к договору, регламентирующему осуществление технического доступа к ПТК, в котором определяются условия использования и администрирования ВПТС и аппаратно-программных шлюзов ММВБ.

2.2. Максимальная допустимая частота подачи ВПТС запросов на получение данных каждого из доступных в Подсистеме ПТК типов составляет четыре запроса в секунду. Данное ограничение не действует для ВПТС, подключенных к локальному серверу доступа Gateway.

2.3. В рамках ВПТС должно поддерживаться ведение Log-файла, в котором отражаются все операции по взаимодействию с ПТК, совершенные с ее использованием, а также их результаты (подача и снятие заявок, заключение сделок, получение информации о ходе торгов и т.д.). Записи Log-файла должны быть привязаны к системному времени соответствующей Подсистемы ПТК. Для надежного функционирования ВПТС рекомендуется обеспечить способность ВПТС корректно восстанавливать текущее состояние после собственных сбоев из Log-файла в любой момент времени торгов в строгом соответствии с состоянием центрального звена Торговой системы.

2.4. В рамках ВПТС должна быть предусмотрена возможность резервирования основных ее элементов и массивов данных, обеспечивающая продолжение участия в торгах при отказе компьютера центральной части ВПТС.

2.5. В рамках ВПТС должны быть предусмотрены средства администрирования и мониторинга работы с клиентами со стороны Пользователя.

2.6. Пользователь должен иметь согласованную с ММВБ инструкцию администратора ВПТС, включающую в себя порядок взаимодействия с ММВБ в нестандартных (чрезвычайных) ситуациях.

2.7. Наименования таблиц, операций и полей ВПТС должны допускать однозначное преобразование для соответствия терминологии, используемой в тех внутренних документах ММВБ, ФБ ММВБ и НТБ, которые регулируют проведение торгов на соответствующем рынке, и в тех внутренних документах ММВБ и НКЦ, которые регулируют осуществление клиринга на соответствующем рынке, а также во внутренних документах ММВБ, регулирующих осуществление технического доступа к ПТК.

2.8. ВПТС должна обеспечивать следующие правила обработки данных:

а) возможность контроля Пользователем любой заявки, вводимой в ВПТС с использованием любых доступных технологий ввода, по всем ее параметрам, с возможностью снятия ее Пользователем в соответствующей Подсистеме ПТК до момента заключения сделки в соответствии с правилами совершения операций;

б) при явном указании Пользователем или обслуживаемым им клиентом Подсистемы ПТК непосредственно при вводе заявки в ВПТС должны обеспечиваться:

- идентификация подаваемой заявки как заявки, подготавливаемой к вводу в соответствующую Подсистему ПТК;

- регистрация подаваемой заявки исключительно в соответствующей Подсистеме ПТК и, как следствие, включение ее в единую книгу (журнал) заявок только данной Подсистемы ПТК в целях последующего возможного заключения сделки в этой Подсистеме ПТК при условии соответствия этой заявки требованиям Правил совершения операций.

2.9. Каждый экземпляр установленной у Пользователя ВПТС должен иметь уникальный идентификатор (учётный номер), который передаётся при регистрации Пользователем в одну из подсистем ПТК.

2.10 Пользователь ВПТС должен иметь возможность получения из соответствующей Подсистемы ПТК с помощью этого или другого ВПТС, установленного у этого Пользователя, информационных сообщений, направляемых уполномоченными сотрудниками ММВБ, ФБ ММВБ, НКЦ, НТБ в адрес данного Пользователя, и, при необходимости, возможность дальнейшей передачи их на рабочие места клиентов этого Пользователя.

2.11. ВПТС должна иметь полную актуальную пользовательскую документацию.