

## Информация о порядке проведения торгов инструментом USDRUB\_WAPO, использующим средневзвешенный курс USDRUB\_TOM на 11:30 мск

1. Инструмент USDRUB\_WAPO (shortname USDRUBWAP0) позволяет заключать сделки по средневзвешенному курсу, рассчитанному по системным сделкам с инструментом USDRUB\_TOM на 11:30 мск. С 15 апреля 2003 г. Банк России использует средневзвешенный курс USDRUB\_TOM на 11:30 в качестве официального курса по паре USDRUB (ссылка на источник – [Информация ЦБ РФ от 14.04.2003 г. «О торгах долларом США»](#)). Порядок проведения торгов, за исключением временного регламента, а также технология заключения сделок, их учёта, отображения для участников и в отчётах аналогичны торгам по цене фиксинга.

2. Режимы торгов (борды) **WAPS** (Системные средневзвешенные) и **WAPN** (Внесистемные средневзвешенные) содержат инструмент **USDRUB\_WAPO** со следующими параметрами:

- Валюта лота: USD
- Сопряженная валюта: RUB
- Дата расчёта средневзвешенного курса: T0
- Дата валютирования: T+1
- Размер лота в режимах WAPS, WAPN: 1 000 USD
- Точность цены: 4 знака
- Время начала торгов на основном и внесистемном режимах: 9:30 мск

В системном режиме WAPS подаются заявки, в которых не указывается конечный контрагент. Информация о заявках, поданных в системном режиме отображается только на рабочих местах участника торгов, подавшего заявку, и не раскрывается другим участникам торгов.

Во внесистемном режиме WAPN подаются заявки с указанием в качестве конечного контрагента конкретного участника торгов (адресные заявки). Информация о заявках, поданных во внесистемном режиме, отображается только на рабочих местах участника торгов, подавшего заявку, и участника торгов, указанного в качестве конечного контрагента.

Предусмотрена возможность раскрывать информацию о наличии заявок в стакане. Функционал реализован в таблице SECURITIES интерфейса IFCBroker34 в полях DPVALINDICATORBUY и DPVALINDICATORSELL, а также в соответствующих полях в терминале MOEX TradeCurrency. Поля принимают значения "Y" в случае, если в стакане есть заявки в соответствующем направлении.

3. Для инструмента WAP предусмотрен отдельный актив **USDW**, доступный в таблице ASSETS шлюзового интерфейса.

4. В шлюзовом интерфейсе используется идентификатор кода позиции (POSITION.TAG) **USWU** – USD/RUB\_WAP - USDW.

5. Сделки с инструментом WAP заключаются следующим образом (более подробное описание см. далее):
  - 5.1. Приём заявок по инструменту WAP осуществляется с 9:30 до 10:00 мск дня расчёта средневзвешенного курса.
  - 5.2. После подачи заявки по соответствующему инструменту WAP происходит проверка заявки на соответствие ее правилам торгов, а также проверка заявки клиринговым центром в порядке, предусмотренном правилами клиринга.

В случае, если результат проверки заявки положительный, заявка регистрируется в торговой системе.
  - 5.3. После регистрации заявки на заключение сделки по инструменту WAP в торговой системе, заявка проходит предварительную проверку на предмет наличия в очереди допустимых встречных заявок на заключение сделки по соответствующему инструменту WAP. При наличии в очереди допустимых встречных заявок происходит регистрация сделки. В сделках по инструменту WAP проставляется код расчётов FIX0.
  - 5.4. На основе сделок по инструментам WAP, заключенных в режимах WAPS или WAPN, после расчета средневзвешенного курса в 11:30 мск в торгово-клиринговой системе заключаются технические сделки по инструменту TOM по соответствующей паре валют и в соответствующих режимах WAPS/WAPN.
6. Заключенные в режимах WAPS/WAPN сделки по инструментам WAP и технические сделки по инструментам TOM не участвуют в расчетах средневзвешенных курсов по соответствующим инструментам.
7. При подаче заявки по инструментам WAP действуют следующие ограничения по сравнению с обычными спот-заявками:
  - 7.1. Доступный тип заявки: только лимитированные. При этом цена не указывается – в поле PRICE указывается «0».
  - 7.2. Айсберг-заявки не принимаются.
  - 7.3. Доступные типы по остатку: поставить в очередь, снять остаток, полностью или отклонить.
8. Информация по заявкам с инструментами WAP не выводится в таблицу ORDERBOOK. Данные о зарегистрированных заявках доступны только выставившим их участникам торгов (табл. ORDERS) и не отображаются в таблицах ASTS с данными по всему рынку (типа SECURITIES), не публикуются на сайте. Цена заявки в таблице ORDERS не заполняется.
9. По встречным заявкам проводится процедура мэтчинга по пересекающимся направлениям Sell и Buy и регистрируется сделка с определенным типом («Т» - сделка в режиме WAPS, и «N» - сделка в режиме WAPN) без указания цены.
10. Информация по собственным сделкам по инструменту WAP (кроме цены и объема в рублях) доступна участнику торгов в таблице TRADES. Информация по всем сделкам по инструменту WAP, а также информация о последней сделке доступна другим участникам торгов – указывается объем в валюте лота по последней сделке и время ее заключения. По всем сделкам указывается суммарный объем в валюте лота и количество сделок за день (табл. SECURITIES, ALL\_TRADES). Данная информация по

сделкам публикуется на сайте и в потоках FAST UDP Multicast Market Data сразу же после их заключения.

11. Аналогично действующей схеме на обычных торгах, заявки по инструменту WAP, по которым заключены сделки, удаляются из очереди заявок. Заявки по инструменту WAP, по которым не были заключены сделки, либо остаток заявок, которые были удовлетворены частично, участник может до 10:00 текущего дня снять в любой момент. С 10:00 текущего дня все заявки по инструменту WAP снимаются торговой системой.
12. В 11:30 мск, после расчета средневзвешенного курса на текущий день, по всем зарегистрированным до 10:00 сделкам с инструментом WAP на основе объемов в этих сделках генерируются и регистрируются соответствующие им технические сделки по инструменту USDRUB\_TOM (в режимах WAPS и WAPN с типом сделки «N»). При этом если по заявке с одним номером зарегистрировано несколько сделок по инструменту WAP, то в системе регистрируется такое же количество технических сделок по средневзвешенной цене и в объемах, соответствующих объемам данных сделок по инструменту WAP.
13. По каждой технической сделке с TOM рассчитывается комиссия.
14. В сделках TOM в поле TRADES.ORDERNO шлюзового интерфейса указывается номер исходной заявки по инструменту WAP. А в поле TRADES.PARENTTRADENO – номер исходной сделки по WAP-инструменту.
15. Особенности работы сервисов FIX и FAST в режиме торгов по средневзвешенному курсу:
  - a. В торговом сервисе FIX Trade по заявкам для инструмента USDRUB\_WAP0 не отправляются сообщения типа ExecutionReport (8) о технических сделках по инструменту USDRUB\_TOM в режиме WAPS. Для получения данных о цене и рублевом объеме этих сделок рекомендуется использовать сервис FIX TradeCapture или другие протоколы подключения. Режим WAPN для этого сервиса недоступен.
  - b. В информационном сервисе FIX DropCopy по заявкам WAP не отправляются сообщения типа ExecutionReport (8) о технических сделках по инструменту USDRUB\_TOM в режиме WAPS. Для получения данных о цене и рублевом объеме этих сделок рекомендуется использовать сервис FIX TradeCapture или другие протоколы подключения. Режим WAPN для этого сервиса недоступен. Сообщения публикуются в пределах полномочий пользователя сервиса DropCopy на доступ к данным ТКС.
  - c. В информационном сервисе MFIX TradeCapture отправляются сообщения типа TradeCaptureReport (AE) для сделок по инструменту WAP и для технических сделок по инструменту USDRUB\_TOM в режимах WAPS и WAPN, с указанием в поле OrderID (37) номера заявки инструмента WAP, и других параметров заявки в соответствующих полях сообщения. Сообщения о сделках публикуются для всех сделок по инструменту WAP в пределах полномочий пользователей, независимо от протокола выставления заявок по ним.
  - d. В потоке сообщений о сделках (TLR) сервиса FAST UDP Multicast Market Data публикуются только сообщения о сделках по инструменту WAP с количеством лотов иностранной валюты и нулевой ценой. Для определения цены и рублевого объема сделки по инструменту WA рекомендуется использовать средневзвешенный курс, публикуемый в потоке market statistics (MSR).