



Ukraine Commodity Clearing
ucclearing.com/agrobot



Инструкция по работе в системе AgroBrokBot Русская версия 4.0

Ссылки по документу:

[Верификация пользователя в системе ABB](#)

[Что нужно знать о Соглашении ISDA](#)

[Доступ к торгам в системе ABB](#)

[Меню AgroBrokBot](#)

[Создание и публикация Заявок в системе ABB](#)

[Заключение Сделок в системе ABB](#)

[Особенности заключения сделок CME BS Futures:](#)

[Дополнительный функционал системы ABB](#)

- Подписка на новости
- PING
- FOK
- Mute List
- Time Limit



Верификация пользователя в системе АВВ

С чего начать?

Для начала использования AgroBrokBot необходимо иметь активное подключение к Интернету, а также установленное приложение Viber на мобильном устройстве, ноутбуке, планшете или ПК.

Как получить ссылку на АВВ?

Вариант 1. Для перехода в бот с ПК или ноутбука пользователь может использовать ссылку с официального сайта компании-разработчика: <https://www.uccclearing.com/agrobot/>

Вариант 2. Пользователь может запросить прямую ссылку на АВВ для своего мобильного телефона. Для этого необходимо обратиться в **Отдел Поддержки пользователей АВВ:**

Support Department АВВ

Viber, звонки, смс	+380631287863
E-mail	agro@uccclearing.com
График работы	Пн-Пт 08:00 - 23:00

Что дальше?

Пользователь переходит по ссылке в Viber и начинает процесс верификации в системе АВВ. Для этого необходимо пройти 3 простых шага:

Шаг 1: Ввести номер мобильного телефона, который планируется использовать для работы в АВВ. На указанный номер придет смс-сообщение с кодом подтверждения, который необходимо будет ввести в диалоговом окне чата.

Шаг 2: Ввести адрес Электронной почты, который планируется использовать для работы в АВВ. На указанный адрес придет письмо с кодом-подтверждения, который также необходимо указать в диалоговом окне АВВ. В дальнейшем на этот адрес будет приходить отчетность по системе АВВ.

Шаг 3: Предоставить следующие документы:

- Сканированное подписанное [Заявление на прохождение аккредитации](#) и регистрации брокера, которое находится в приложении к письму или можно скачать с официального сайта.
- Все [другие документы](#) в соответствии с перечнем и порядком, предусмотренными Правилами Биржевой торговли, утвержденными Биржей второго апреля 2018 года, включая [опросник](#).

Данные файлы можно отправить также в Viber. После того, как пользователь отправил документы на проверку администратору, он нажимает кнопку в меню бота "**Отправить заявку на верификацию**".

Документы пересматриваются администратором АВВ. Администратор АВВ должен или одобрить пользователя для использования Платформы или требовать разъяснений или дополнительных документов. Администратор имеет право требовать любые дополнительные документы и информацию в любой момент после предоставления пользователю доступа к платформе. В случае отсутствия той или иной информации/документа от пользователя, Администратор АВВ помогает с верификацией и просит внести корректировки в данные.

По результатам проверки информации администратором АВВ пользователю приходит сообщение с подтверждением доступа: "**Администратор верифицировал Ваш аккаунт! Теперь Вы можете пользоваться ботом!**"

Поздравляем! Верификация пройдена!





Что нужно знать о Соглашении ISDA

NB !: приведённые ниже краткие пояснения являются очень суженным толкованием лишь некоторых положений ISDA и не дадут полное представление о многогранности, уравновешенности и справедливости положений ISDA, а также не является юридической консультацией

1. Возможность требовать уплаты финансового обеспечения

1.1. Как рассчитать сумму требований стороны сделки (variation margin).

Каждый рабочий день АББ отправляет участникам торгов MtM-отчет. В колонке «Credit MtM» содержится значение, которое составляет сумму переоценки открытой позиции против каждого контрагента по каждому заключенному деривативу по каждому расчетному периоду и в целом по всем контрактам с одним контрагентом, то есть сальдо всех обязательств между Вами и одним из Ваших контрагентов, что и является Экспозицией (Exposure), то есть размером вариационной маржи, но без учета сумм уже перечисленного гарантийного обеспечения.

1.2. Когда можно требовать уплаты вариационной маржи?

Уплату вариационной маржи можно требовать немедленно после достижения соответствующих лимитов - не менее 20 000 долл. - кредитного лимита и не менее 5000 долл. сумма одного платежа.

Оплатить такую вариационную маржу нужно немедленно. Однако требование оплатить вариационную маржу является правом контрагента, а не его обязанностью. Приостановка в реализации своих прав по договору или требование реализовать их в меньшем объеме не означает отказ стороны от реализации этого права в будущем.

Проценты на перечисленное гарантийное обеспечение не начисляются.

2. Возможность объявить все требования подлежащими выполнению

В случае наступления Случая неисполнения обязательств, сторона, которая не нарушает, имеет право расторгнуть договор с нарушителем, при этом объявить все обязательства этой стороны подлежащими исполнению, необходимо справедливо оценить размер таких обязательств по всем заключенным соглашениям с контрагентом-нарушителем, нарушитель должен дать согласие и такой взаимозачет, но не имеет права задерживать предоставление такого согласия. При этом суммируются все прямые и косвенные убытки, причиненные нарушением обязательств, оценивается сумма компенсаций, исходя из рыночных котировок, аналогичных контрактов, другой рыночной информации.

Так, сторона, которая не нарушает, должна направить сообщение контрагенту-нарушителю, в котором указать случай невыполнения обязательств, который стал основанием для расторжения договора, дату расторжения договора (но не менее 20 дней с момента отправки / получения уведомления), описать все незакрытые сделки и обязательства по ним, по возможности оценить сумму обязательств контрагента-нарушителя перед своей компанией и своих обязательств перед нарушителем и тому подобное. Контрагент-нарушитель должен немедленно принять меры для уменьшения убытков своего контрагента, причем сторона, которая не нарушает тоже сама должна прилагать все разумные усилия для уменьшения и предотвращения нанесения ущерба.

К Случаям неисполнения обязательств относятся:

- 1) Неосуществление платежа или поставки.
- 2) Нарушение соглашения; Аннулирование сделки.
- 3) Невыполнение обязательств, связанных с предоставлением кредитной поддержки.
- 4) Введение в заблуждение.
- 5) Невыполнение обязательств по определенной сделке.
- 6) Перекрестное нарушено обязательств.
- 7) Банкротство.
- 8) Слияние без принятия обязательств.





К случаям, которые являются основанием для расторжения договора, кроме случаев невыполнения обязательств, относятся:

- 1) Незаконность;
- 2) Обстоятельства непреодолимой силы;
- 3) Случай налогообложения;
- 4) Случай налогообложения при слиянии;
- 5) Случай снижения кредитоспособности при слиянии.

3. Механизм расчета обязательств при наступлении определенных случаев, которые представляют реальную угрозу выполнению обязательств контрагента, в том числе путем зачета встречных обязательств (ликвидационный неттинг), что позволяет не ждать наступления срока расчета по свопу, а обращаться к арбитражу для получения решения и обращение его к исполнению и принудительного взыскания активов.

Если коротко, то в случае расторжения договора суммируются все взаимные обязательства сторон и подлежат уплате как «Сумма закрытия», причем, если обязательства должны выполняться в будущем и в связи с этим их размер трудно оценить, то ISDA предлагает методики такой оценки, основанные на стоимости сделок, которые заменяют уже заключены соглашения, и рыночная информация.

Каждый действительный случай невыполнения обязательств и основания для расторжения договора подлежат анализу в каждой конкретной ситуации, однако нужно обратить Ваше внимание на следующее положение, определяющее сумму платежа при расторжении договору. Сумма платежа при досрочном прекращении договора составляет: $A + B - C$, где

A - эквивалент в валюте прекращения суммы закрытия или суммы закрытия (положительное или отрицательное значение), что определяется стороной, которая не нарушает, исходя из рыночной информации по каждой сделке, что прекращается или группе сделок, которые прекращаются (в зависимости от конкретного случая)

B - сумма задолженности перед стороной, которая не нарушает,

C - сумма задолженности перед стороной которая нарушает.

4. Другое.

Предполагается решения, в частности, для следующих случаев:

- a. если при заключении соглашения законодательство стран контрагентов сделки не предусматривало каких-то налоговых обязательств, но во время действия соглашения такие страны внедрили налогообложения деривативов, то стороны должны отступить свои права и обязанности по заключенным сделкам на другие свои юрлица так, чтобы случай расторжения сделки не существовал;
- b. если любая часть соглашения будет признана недействительной или такой, что не может быть выполнена, стороны должны заменить такую недействительной норму другой, которая не противоречит требованиям применяемого законодательства и позволит сторонам достичь эффекта, который они задумывали при заключении сделки.



Доступ к торгам в системе АВВ

При заполнении файла Application пользователю необходимо отметить какими из предоставляемых платформой видами контрактов планирует торговать компания

★ **Компаниям-Резидентам** Украины в связи с валютным регулированием доступ предоставляется **только к DELIVERY** контрактам

★ **Компаниям-Нерезидентам** доступны **SWAP** и **DELIVERY** контракты

★ торги **CME Black Sea futures block trades**. Для этого необходимо:

- 1) открыть счет у любого clearing broker'а члена Чикагской биржи (полный список брокеров доступен по [ссылке](#))
- 2) пополнить счёт на сумму необходимую для торгов,
- 3) подать соответственно оформленное заявление и надлежащим образом авторизировать Товарную биржу «Центральный товарный контрагент» перед клиринговой фирмой

После успешного прохождения процесса верификации у пользователя появляется доступ к отдельным чатам для реализации торговли беспоставочными и поставочными контрактами в системе АВВ по следующим видам культур:

Non-deliverable contract	Delivery Contracts	CME Black Sea Futures
SWAP CPT UKR BARLEY	DELIVERY CPT BARLEY	CME BWF (BlackSea Wheat Futures)
SWAP CPT UKR CORN	DELIVERY CPT CORN	CME BCF (BlackSea Corn Futures)
SWAP FOB RUS MW12.5	DELIVERY CPT WHEAT 12.5	
SWAP CPT UKR MW11.5	DELIVERY CPT WHEAT 11.5	
SWAP FOB UKR CORN	DELIVERY CPT FEED WHEAT	
SWAP FOB UKR SUNOIL	DELIVERY FOB BARLEY	
	DELIVERY FOB CORN	
	DELIVERY FOB WHEAT 12.5	
	DELIVERY FOB WHEAT 11.5	
	DELIVERY FOB FEED WHEAT	
	DELIVERY FOB SUNOIL	

С детальным описанием контрактов можно ознакомиться на [Официальном сайте компании УСС](#)

Какие контракты доступны пользователю?

Для перехода к перечню доступных контрактов пользователю необходимо воспользоваться кнопкой **“ДОСТУП К ТОРГАМ”** в Меню Пользователя



SWAP CPT UKR BARLEY	DELIVERY CPT BARLEY	DELIVERY FOB BARLEY	TEST BWF
SWAP CPT UKR CORN	DELIVERY CPT CORN	DELIVERY FOB CORN	TEST BCF
SWAP FOB RUS MW12.5	DELIVERY CPT WHEAT 12.5	DELIVERY FOB WHEAT 12.5	
SWAP CPT UKR MW11.5	DELIVERY CPT WHEAT 11.5	DELIVERY FOB WHEAT 11.5	
SWAP FOB UKR CORN	DELIVERY CPT FEED WHEAT	DELIVERY FOB FEED WHEAT	
SWAP FOB UKR SUNOIL		DELIVERY FOB SUNOIL	



Меню AgroBrokBot



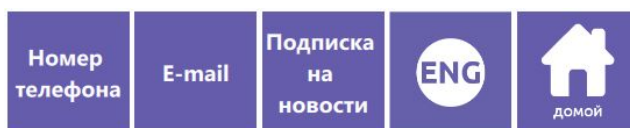
Мои заявки - позволяет пользователю просмотреть свои заявки (тип контракта, цена, объём, месяц экспирации, статус). Для изменения заявок требуется перейти в соответствующий чат.

<p>КУПИТЬ SWAP FOB UKR CORN Март - 2019 (заявка на покупку) Объём: 24800 Цена: 163.00 Дата публикации: 30.11.2018 10:53:28</p>	<p>ПРОДАТЬ SWAP CPT UKR MW11.5 Январь - 2019 (заявка на продажу) Объём: 45000 Цена: 211.00 Статус: Скрытая заявка</p>
---	---

Мои сделки - позволяет пользователю видеть все свои сделки (активные, подтвержденные, отклоненные) и их детали.

Рынок - позволяет посмотреть индексы (средняя цена на определенный продукт за сегодня и средняя цена за данный месяц) по всем контрактам.

Настройки:



- Номер телефона - номер телефона, который используется для работы в АВВ. Доступно изменить текущий номер телефона.
- E-mail - электронный адрес почты, на который приходят документы по сделкам. Доступно изменить текущий электронный адрес почты.
- Подписка на новости - описание в разделе **Дополнительный функционал**.
- Язык интерфейса (ENG / РУ) - при нажатии меняется язык интерфейса бота.
- Домой - возврат в основное меню без изменений.



Создание и публикация Заявок в системе АВВ

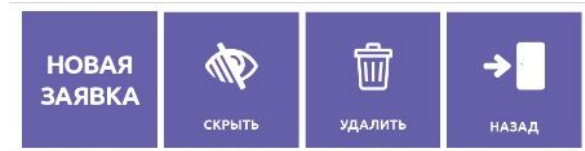
После перехода в один из чатов по выбранному типу контракта, пользователю доступно меню:

Меню Чата



МОИ ЗАЯВКИ

После нажатия Мои заявки, пользователь попадает в подменю:



Новая заявка - позволяет создать новую заявку.

Скрыть - позволяет перевести все заявки пользователя в статус **Скрытые заявки**.

Удалить - позволяет удалить все заявки пользователя.

Назад - позволяет вернуться в Основное меню чата AgroBrokBot

Как создать заявку?

Нажатием кнопки **“НОВАЯ ЗАЯВКА”** начинается процесс её создания: выберите **месяц** экспирации, далее **тип** заявки (покупка/продажа), **объём** товара, **цена** за 1 тонну (в долларах США). Пользователь может нажать кнопку **СОХРАНИТЬ**, чтобы вернуться к созданию заявки позже.

Особенности СМЕ BS Futures:

Торговля в BS ведется в контрактах. Мультипликатор 1 контракта - 50 метрических тонн. Цена указывается за 1 тонну. Минимальная заявка – 5 контрактов. Шаг объема – 1 контракт, **цена** за 1 тонну в долларах США (шаг цены – 0.25 доллара за тонну).

Непосредственно после создания, заявка находится в статусе **“Скрытая заявка”** и недоступна для мэтчинга с заявками других пользователей. Пользователь проверяет введенные ранее данные, после чего имеет возможность опубликовать заявку, нажав кнопку **“ОПУБЛИКОВАТЬ”** или **“ОПУБЛИКОВАТЬ с timelimit”** (указывается время автоматического снятия заявки с рынка в формате чч:мм).

Внимание! В 23:00 происходит закрытие Торговой Сессии и все **Опубликованные заявки** становятся **Скрытыми!** Для поддержания заявки в актуальном состоянии пользователь должен её снова опубликовать.

Статусы заявок:

- **Черновик** - незавершённая заявка. Заявка, в которой отсутствует цена или объём;
- **Скрытая** - неопубликованная заявка, доступна для редактирования и публикации;
- **Активная** - опубликованная заявка, доступна для мэтчинга. Чтобы снять с публикации или отредактировать активную заявку, необходимо перейти в **“Мои заявки”**, найти ее в списке и нажать кнопку **“Снять с публикации”**. Заявка не может быть отредактирована, пока находится в статусе **Опубликованная заявка**.





Заключение Сделок в системе АВВ

После размещения заявки наша система ищет подходящую встречную заявку в соответствии с заданными параметрами. Если заявка не была найдена, то Ваша заявка становится в очередь на мэтчинг, по принципу FIFO. Как только встречная заявка будет опубликована в системе, контрагенты получат об этом уведомление и перейдут в меню заключения сделки.

Мэтчинг происходит при совпадении заявок по следующим параметрам:

- **Одинаковый Инструмент/Контракт**
- **Месяц и год экспирации Инструмента/Контракта**
- **Цена.** В случае, если цена продажи меньше цены покупки, мэтчинг происходит по цене продажи.
- **Объём.** В случае, если 3 предыдущих параметра совпали, но объём заявок не совпадает, мэтчинг происходит по объёму заявки с меньшим объёмом. При этом заявка с большим объёмом автоматически разделяется на две заявки:
 - 1) заявка с подходящим количеством объёма сформирует сделку.
 - 2) новая заявка на остаток объёма возвращается в очередь на мэтчинг по принципу **FIFO**.

По вашей заявке " SWAP FOB UKR CORN Январь (2019) (Продать) - 162.00 (15000)" найдена встречная заявка, на основе которой создана сделка.

По вашей заявке " SWAP FOB UKR CORN Январь (2019) (Продать) - 169.00 (17000)" найдена встречная заявка, на основе которой создана сделка. Так как встречная заявка имеет меньший объём (5000), создана новая заявка на продажу с объёмом 12000 тонн по цене 169.00\$ за тонну.
Детали сделки:

Принцип **FIFO** (first in first out) - первым всегда обслуживается контрагент, который выставил заявку раньше других контрагентов.

Возможности перед заключением сделки:



Подтвердить сделку - подтверждение заданных изначально параметров сделки (цена и объём). Сделка считается состоявшейся с момента, когда обе стороны подтвердили сделку. Все сделки сохраняются в истории сделок. Чтобы посмотреть историю, достаточно через кнопку **ДОМОЙ** перейти в меню **"Мои сделки"** - **"Подтвержденные сделки"**.

Отклонить сделку - отклонение сделки с указанными параметрами (цена и объём). Если сделка отклоняется, то обе Стороны переходят по отношению друг к другу в **Mute list**. Автоматический мэтчинг заявок между сторонами прекращен на 365 дней.

Изменить объём - предложение изменить объём товара. Сторона 2 может подтвердить или отклонить предложение. До момента подтверждения или отклонения предложения, сделка находится в статусе **Активная сделка**. **Внимание! Изменить объём возможно только 1 раз за сделку!**
Подтверждая изменение объёма, пользователь подтверждает сделку!

Чат с контрагентом - диалог между контрагентами для обсуждения ключевых моментов поставки, транспортировки, а также любых других деталей.

История чата - полная история диалога между контрагентами доступна для просмотра.



Отозвать подтверждение - возможность отозвать подтверждение по заявке до того, как Сторона 2 подтвердила сделку. После того, как Сторона 1 отозвала своё подтверждение, Стороне 2 предлагаются 10 минут для принятия решения: подтвердить или отклонить сделку





История и поиск сделок:



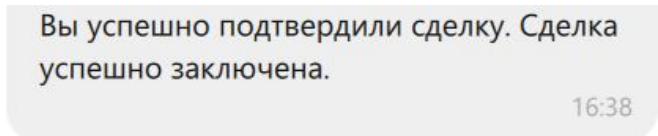
Активные сделки - сделки, которые ожидают решение обеих Сторон.

Внимание! Все активные сделки отменяются автоматически по окончании рабочей сессии, в 23:00 по Киеву!

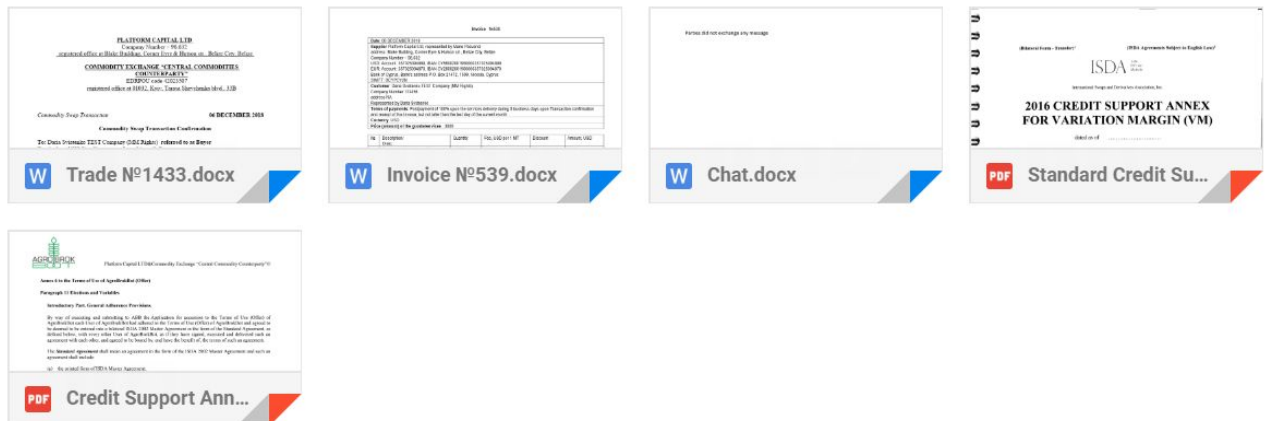
Подтвержденные сделки - история подтвержденных сделок обеими Сторонами за всё время.

Отклоненные сделки - история отклоненных сделок одной из Сторон за всё время.

Последний этап по заключению сделок:



В случае если сделка подтверждена двумя Сторонами, она получает статус “Подтвержденная” с учётом всех изменений, если таковы были. По результатам заключения сделки, каждая Сторона получает электронное письмо с документами о проведенной сделке и историю переписки с контрагентом:

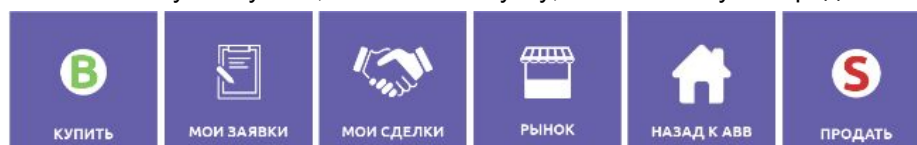


Сделка может быть отменена по следующим причинам:

- Пользователь отписался от бота
- Пользователь был заблокирован
- Одна из Сторон отклонила сделку
- Сторона 1 отозвала подтверждение сделки, а Сторона 2 не подтвердила сделку в течении 10 мин
- Если ни одна из Сторон не подтвердила сделку, то она отменяется автоматически в 23:00 в конце рабочей сессии

На платформе АВВ также доступна торговля в ручном режиме.

Активные заявки на продажу, которые на данный момент находятся в стакане, пользователь может просмотреть нажав на кнопку **В** - купить; заявки на покупку, нажав кнопку **S** - продать.



Выбрав подходящую заявку вручную, пользователь может нажать на нее и перейти непосредственно в меню создания ответной заявки, а затем и к самой сделке.





Особенности заключения сделок CME BS Futures:

В данном виде сделок после мэтчинга заявок пользователь не получает сведений о том, кто именно является второй стороной. В то же время пользователь получает уведомление о встречной заявке с предложением подтвердить сделку с заявленной ценой и объемом заявки или изменить их по согласованию с контрагентом.

Пользователю также доступен чат со второй стороной, где он может уточнить интересующие его детали или выразить свое абсолютное согласие с условиями сделки. Транскрипт чата пользователь получает в электронном виде на e-mail по завершению сделки.

Если пользователь «отказался» от заключения сделки, то его сделка отменяется, а заявка переходит в статус «Скрытая». Заявка другой стороны возвращается в рынок.

Если обе стороны «подтвердили» сделку, им приходит уведомление от администратора АББ о том, что «Клиринг сделки в процессе». В этот момент возможности отменить сделку нет.

В случае если клиринг успешный, стороны сделки получают подтверждение о состоявшейся сделке и инвойс на оплату комиссии на электронную почту (0,2 доллара за тонну).

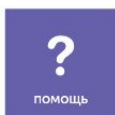
Если клиринг НЕ успешный, то

1) в чате CME BS Вам придет уведомление с причиной отказа, например запрет торговать этим инструментом/ закрыт счет/ УСС не имеет доступа к счету клиента и тд. В таком случае сделка ОТМЕНЯЕТСЯ, заявка клиента, у которого возникли трудности при клиринге снимается. Заявка второго клиента возвращается в рынок.

2) в чате CME BS может прийти сообщение с предложением стороне, у которой не хватает средств уменьшить объем сделки путем ввода нового объема контракта. Если Пользователь согласен, то процесс клиринга повторяется с учетом нового объема сделки. Если же такой вариант не подходит – заявка снимается, сделка отменяется.

3) Дополнительным вариантом для стороны, у которой не хватает средств является возможность «сделать сделку путем заключения SWAP контракта». В таком случае вторая сторона получит об этом уведомление с возможностью : согласиться или отказаться.

При обоюдном согласии пользователи автоматически переходят в состояние сделки в чатах SWAP FOB CORN для CME BCF и SWAP FOB RUS MW 12.5 для CME BWF соответственно.



В случае, если возникли сложности по размещению заявок или заключению сделок, пользователь всегда может найти контактные данные Службы поддержки перейдя по иконке “Помощь”!



Дополнительный функционал системы АВВ

Подписка на новости

подписка на оповещения в рамках одного отдельного чата о новых заявках и новых заключенных сделках от других пользователей.

Главное меню - Настройки - Подписка на новости

Список доступных новостей:



Внимание! Одновременно доступен только 1 тип подписки на новости из предложенных: Контракт/Контракт и месяц/Диапазон! Можно изменить в любое время.

- **Контракт** - уведомление о новых заявках в определенном чате, в котором ранее выставлена заявка пользователя.
- **Контракт и месяц** - уведомление о новых заявках в данном типе контракта и месяце, в котором ранее выставлена заявка пользователя.
- **Диапазон** - информация в каком диапазоне цены (число) от лучшей заявки пользователя показывать уведомления о встречных заявках.
- **Показывать мои цены** - скрывает указанную цену заявки при публикации.



- **Выключить** - отписаться от новостей.
- **Отменить** - вернуться без каких-либо изменений.

PING

функция, которая позволяет напрямую обратиться к контрагенту с лучшей встречной заявкой и заключить сделку по промежуточной цене между бидом и оффером.

Доступ к торгам - Выбираем контракт - Рынок - Предложить PING

FOK

заявки типа «Fill or kill» или «Выполнить или аннулировать» очень широко распространены среди игроков биржевого рынка. Суть заключается в выставлении четких критериев в заявке на покупку или продажу определенного актива, в случае невыполнения которых заявка аннулируется автоматически.

Доступ к торгам - Выбираем контракт - Мои заявки - FOK



Mute List

Если Сторона 2 находится у Стороны 1 в списке “mute list”, это означает, что не будет происходить автоматический мэтчинг заявок между этими Сторонами. Длительность пребывания в “Mute List” составляет 365 дней. Стороны автоматически попадают в Mute List после отклонения сделки одной из сторон.

Timelimit

публикация заявки с пометкой “timelimit” дает возможность пользователю указать в отдельной заявке время её автоматического снятия с рынка. Заявка из статуса “Опубликованные” попадает в статус “Скрытые”.

Доступ к торгам - Выбираем контракт - Мои заявки - Опубликовать с timelimit

В случае, если у Вас возникли сложности по заключению сделок, пользователь всегда может найти контактные данные Службы поддержки перейдя по иконке “Помощь”!

