Приложение № 4

ТЕХНИЧЕСКА СПЕЦИФИКАЦИЯ ЗА ОБОСОБЕНА ПОЗИЦИЯ 2

|  |  |
| --- | --- |
| ОПИСАНИЕ НА ИЗИСКВАНЕ[[1]](#footnote-1) | ПРОДУКТИ |
| Общи изисквания |  |
| Предлагания набор от продукти трябва да отговаря и на слените общи изисквания: |  |
| Функционални изисквания |  |
| * + 1. да предоставят независима информация за кредитни анализи/оценки, в т.ч. информация за кредитни рейтинга на страни, наднационални институции, агенции, финансови институции, корпоративни компании и др., като кредитните оценки по възможност да бъдат от голям брой международно-признати агенции за кредитен рейтинг; | 1  2 |
| * + 1. да предоставя непрекъснат поток от обективна и безпристрастна информация, представляваща новини за събития от политически и икономически характер в глобален мащаб. В потока от новини и събития всички континенти и региони следва да бъдат представени балансирано и да отразява различните гледни точки на преките участници и на коментаторите. Участникът следва да публикува новини от различни информационни агенции (вкл. и от свои конкуренти) и други източници – централни банки, правителства, компании, борси и т.н. Участника следва ясно да обозначава дали информацията е получена от собствени източници или от трети страни. Информацията следва да може да бъде класифицирана/сортирана по различни критерии, напр. по региони, държави, групи от държави (Еврозона, Г-8, ОИСР), компании, сектори, класове активи и т.н., вкл. и по свободно избрани критерии, дефинирани от крайния потребител | 1  2 |
| * + 1. да поддържа календар за предстоящи събития за сравнително дълъг период от време, съдържащ както стандартни дати за оповестяване/публикуване на регулярни икономически данни (напр. емисионни календари, емисии на облигации и акции, БВП, инфлация, безработица, и т.н.), така и на основните политически събития (например местни и общи избори, срещи между лидери, форуми и т.н.) | 1  2 |
| * + 1. да се появява по най-бързия възможен начин актуална информация за изявления на политически лидери, ръководители на централни банки, мениджъри на големи корпорации и институционални инвеститори. Възможности за предаване на пресконференции на централни банки (напр. ЕЦБ) в реално време ще бъде предимство | 1  2 |
| * + 1. да съдържа и/или да предоставя достъп до различни пазарни анализи и коментари по бизнес и политически въпроси от широк кръг източници за различни класове активи, държави, емитенти и др. | 1  2 |
| * + 1. да се поддържат актуални данни за прогнозите и/или очакванията на различни пазарни участници за най-важните икономически показатели на отделните държави, икономически зони, емитенти, корпорации и др., получавани чрез регулярни допитвания или проучвания на мненията на професионалната общност, организирани и менажирани от участника или от трети страни | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможности за запис на новини и събития във външен файл | 1  2 |
| * + 1. да поддържа архив на новините и събитията за сравнително дълъг период от време | 1  2 |
| * + 1. да има вградени възможности и да поддържа статични и динамични данни за инструментите и пазарите на: | 1  2 |
| * + *облигации и други дългови инструменти, вкл. държавни, общински, регионални, наднационални, агенции, корпоративни, обезпечени, ипотечни, конвертируеми, инфлационно индексирани и др. с или без вградени опции;* |  |
| * + *инструменти на паричния пазар, вкл. краткосрочни дългови ЦК, депозитни сертификати (CD), търговски ефекти (CP), нива на Репо-лихви на различни финансови инструменти, индекси за цената на заемния ресурс (напр. Libor, Euribor) за всички валути, Суоп и Форуърд криви и др.;* |  |
| * + *злато и други благородни метали;* |  |
| * + *борсово търгувани финансови продукти (фючърси, ETFs и др.), стоки, суровини и материали;* |  |
| * + *акции и други (производни) инструменти, имащи характеристиките на собствен капитал;* |  |
| * + *валути – за всякакви сетълмънт дати търгувани на пазара;* |  |
| * + *деривативни продукти – лихвени, инфлационни, кредитни, валутни и т.н.;* |  |
| * + *премии за кредитен риск измерени със спредовете по договори за кредитно неизпълнение (CDS) и със спредовете по корпоративен дълг на отделни емитенти;* |  |
| * + 1. да позволявала бързо намиране на всеки инструмент и да поддържа всички местни или международно приети идентификатори свързани с него | 1  2 |
| * + 1. да има възможност да предоставя в реално време достъп до информация за цените и обемите на търгувани стоки и финансови активи на регулираните пазари (борси) в основните финансови центрове в глобален мащаб | 1  2 |
| * + 1. да предоставя информация за първичния и вторичния пазар на всички инструменти търгувани извънборсово. Участникът следва да има сключени споразумения с широк кръг пазарни участници, и особено с банки и финансови инвестиционни посредници с висок кредитен рейтинг (дългосрочен мин. А-), за предоставяне на техни цени и друга пазарна информация в реално време на всички класове активи, търгувани на международните финансови и стокови пазари. Системата на участника следва да може да агрегира получаваната от различни източници информация за пазара на даден актив и да съдържа агрегирани показатели за цените, обемите, волатилността, ликвидността, спредове и други подобни свързани пазарни данни/характеристики по отделни инструменти, групи, класове активи, в произволно избрани валути и т.н. Методиките за агрегиране следва да са добре документирани, а източникът на конкретни цени/данни ясен за потребителя | 1  2 |
| * + 1. да има вградени стандартни и широко приети от индустрията методологии за оценка и корекция на пазарната цена на слабо ликвидни или временно неликвидни инструменти | 1  2 |
| * + 1. да поддържа пълното описание на реквизитите на всички инструменти съгласно условията на емитирането им (пускането им в обръщение), както и евентуални промени в правния статус, вкл. с възможност за достъп до проспектите, ако има такива | 1  2 |
| * + 1. да има вградени методологии за извличане от цените на инструментите на пазарните доходности на облигациите на всички емитенти – публични и копроративни – за различни матуритети и да конструира и поддържа съответни криви на доходност. Кривите на доходност следва да могат да се съставят както от текущи активни ЦК (on- и off-the-run), така и на базата на обобщаващи (generic) характеристики за матуритетните точки. Системата следва да позволява лесно и бързо съпоставяне на отделните емитенти във времето и пространството (напр. наслагване на кривите на доходност на отделни държави, спредове и т.н.) | 1  2 |
| * + 1. да бъде използвана от водещи и утвърдени глобални финансови институции за публикуване и разпространение на съставяни и поддържани от тях индекси за различни пазари, класове активи, сектори, емитенти и т.н. В допълнение, Системата трябва да има функционалност за дефиниране на собствени индекси от страна на потребителя, на базата на налични серии от статистически редове за различни променливи | 1  2 |
| * + 1. да бъде използвана от водещи и утвърдени глобални финансови институции за поддържане на собствени страници с информация предназначена за техни клиенти и бизнес партньори | 1  2 |
| * + 1. да има изградени и поддържани специализирани и лесно достъпни страници с широк кръг информация от и за централните банки от основните търговски центрове на всички континенти, вкл. но не само паричната им политика и целеви лихви, официални позиции, изявления, речи и изказвания на представители, документи и решения, календар на оповестяване на решения и т.н. | 1  2 |
| * + 1. да има изградени и поддържани специализирани и лесно достъпни страници с широк кръг бизнес и политическа информация за всички държави, вкл. и за икономически зони (напр. Еврозона). Системата трябва да разполага с богата база данни за анализиране на отделните индустрии/сектори по държави, вкл. в голяма детайлизация на банковите системи, както и да позволява тяхното анализиране с помощта на графични и статистически методи | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможност за динамична връзка (експорт) в реално време на пазарните цени и други пазарни данни от Системата в различни широко приети от индустрията формати, вкл. електронни таблици (Excel). Цените и другите пазарни данни към края на деня (при затваряне на даден пазар) следва да може да се експортират чрез широко приети от индустрията стандартни протоколи за комуникация | 1  2 |
| * + 1. да позволява извличане (експорт) на богата база исторически икономически и финансови данни чрез широко приети от индустрията стандартни формати и протоколи за комуникация, вкл. за електронни таблици (Excel) и специализирани програми за статистическа или иконометрична обработка на данни. | 1  2 |
| * + 1. да може да индикира, вкл. чрез звуков сигнал, потребителя при големи промени в широк кръг пазарни величини – цени, обеми, волатилности, публикуване на икономически данни и др. подобни | 1  2 |
| * + 1. да може да предоставя на потребителя пазарната информация освен в числов/табличен, така и в графичен режим. Системата трябва да има много добре развита функционалност за графично представяне на данни, чрез вградени шаблони (templates) или дефинирани от потребителя характеристики, представящи в обобщен вид основните/базовите, или избрани от потребителя, статистики за изобразяваната променлива | 1  2 |
| * + 1. да поддържа архив на пазарните цени и други данни (исторически редове) за възможно най-дълъг период от време | 1  2 |
| * + 1. да има вградени аналитични функции и да използва широко приети от индустрията методологии за фундаментален, технически и статистически анализ на различните видове макроикономически и финансови индикатори, финансови инструменти и други данни и променливи намиращи се в Системата или въвеждани от потребителя | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможност на потребителя да може да въвежда и оценява характеристиките и резултатите на собствени стратегии за потенциални сделки (симулация на сделки) между различни инструменти; | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможност на потребителя да извършва комплексен анализ при различни сценарии за пазарните фактори; | 1  2 |
| * + 1. да може да извлича данни за риск характеристиките и други параметри за отделните финансови инструменти, валути и търгувани стоки от наблюдаваните цени на пазарите | 1  2 |
| * + 1. при възможност да има вградени функционални възможности за дефиниране и поддържане на портфейли от произволно избрани инструменти и класове активи, както и извършването на различни симулации и анализи с тях; | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможност на потребителите да комуникират с други потребители в реално време, и/или чрез изпращане/получаване на съобщения. Системата следва да поддържа архив на тези комуникации за сравнително дълъг период от време; | 1  2 |
| * + 1. да има вградени интерфейсни възможности за комуникация с други системи, използвайки широко приети от индустрията протоколи за комуникация; | 1  2 |
| * + 1. да има потребители от всички континенти, да е широко използвана от професионалната общност и да се ползва с добра репутация между пазарните участници като надежден източник на информация, включително от всички контрагенти на БНБ; | 1  2 |
| * + 1. да позволява индивидуализация на настройките и изграждане на работно пространство на ниво отделен потребител; | 1  2 |
| * + 1. да има възможност за дефиниране на бутони за бърз достъп до функции и да предоставя възможност за бързото им повикване на екран чрез използване на софтуерни бутони и/или хардуерно – чрез специализирана клавиатура разработена, поддържана и оставаща собственост на участника; | 1  2 |
| * + 1. да осигури 24ч./7дни функциониране и непрекъсваем достъп | 1  2 |
| * + 1. да има вградена функционалност за оказване на помощ на крайния потребител по отношение използването на различни вградени функции и възможности предоставяни от нея, вкл. помощни документи и статии, които ясно да обясняват основните приложения на новите функции на Системата и които да са достъпни без допълнителни разходи за потребителите; | 1  2 |
| * + 1. да осигурява възможност, при желание БНБ да може да поддържа собствени страници с данни, като определя и контролира достъпа на потребители до тях единствено по своя преценка; | 1  2 |
| * + 1. да има вградени интерактивни менюта и динамично подсказване на вградени в системата функции и друга информация при въвеждане или търсене от страна на потребителя; | 1  2 |
| * + 1. да предоставя възможност за създаване на повече от един профил на потребител на някои терминали, а на други да ограничава достъпа до точно определен потребител; | 1  2 |
| * + 1. да поддържа календар с работните и почивните дни по държави, времевите зони и текущия час в основните финансови центрове, речник на специализираните финансови термини и друга подобна полезна информация; | 1  2 |
| * + 1. да позволява проследяване на специфични новини с висока честота, свързани с публично-търгуваните финансови институции с операции в България. | 1  2 |
| * + 1. да предоставя актуални новини за банковата и финансовата система в България, в т.ч. оценки и аналитични материали на водещи международни инвестиционни банки и рейтингови агенции за рисковия профил на страната и банковата система | 1  2 |
| * + 1. да позволява проследяване на следните основни раздели финансова информация и индикатори: | 1  2 |
| * + *премии за кредитен риск измерени със спредовете по договори за кредитно неизпълнение (CDS) и със спредовете по корпоративен дълг на отделни емитенти;* |  |
| * + *цени на акции на банки и финансови институции в реално време, в т.ч. водещи борсови индекси по държави;* |  |
| * + *финансови отчети на банки, финансови институции и други емитенти на дълг;* |  |
| * + *навременна информация за рейтингови оценки от водещи рейтингови агенции;* |  |
| * + *данни за задлъжнялостта на отделни емитенти на дълг;* |  |
| * + *данни за параметри на отделни емисии на финансови инструменти, като дюрация, актуална цена, дата на издаване, обем при издаване, срок до падеж, рейтингови нива, сектор и индустрия на емитента;* |  |
| * + *бази-данни с публично-оповестявана информация от трети страни, в т.ч. Евростат, ЕЦБ, ЕБО, МВФ, БМР и др.;* |  |
| * + *статистически редове и високочестотна информация с данни от основни парични и дългови пазари по страни, включително криви на доходност на паричния пазар, държавен и корпоративен дълг;* |  |
| * + *статистически редове и високочестотна информация за валутни курсове;* |  |
| * + *композитни индекси на фючърсни, валутни и дългови пазари, в т.ч. индекси, отчитащите дълговите премии по старши и подчинен банков дълг;* |  |
| * + 1. да предоставя възможност за оформяне на бази данни с наличните данни в MS Excel според конкретни нужди на потребителя към даден момент, което да има функционалност за сваляне на голямо количество времеви редове от статистически серии (time-series) и информация за отделни параметри в даден момент (cross-sectional). | 1  2 |
| * + 1. Трябва да има възможност за използване на предварително разработени от участника продукти в MS Excel (templates); | 1  2 |
| * + 1. да позволява получаване на финансова информация относно валутни курсове, доходност по европейски и български облигации, котировки „купува“ и „продава“ за необезпечени депозити в евро с различни срочности. | 1  2 |
| * + 1. да позволява получаване на специализирани финансови новини и макроикономически индикатори, информация за борсовата търговия в Европа, САЩ и Азия. | 1  2 |
| Съответствие с правила и политики |  |
| * + 1. Изпълнителя по тази процедура трябва да декларира, че ще се съобрази с политиките на БНБ свързани с информационната сигурност. | 1  2 |
| Технически изисквания |  |
| * + 1. Използвани устройства   За да бъде достъпна информацията по обособена позиция 2 трябва да бъдат използвани компютри на възложителя, на които има инсталиран софтуер, предоставен от изпълнителя. Софтуера, предоставен от изпълнителя да позволява работа с компютърна конфигурация, оборудвана с два или повече екрана. Ако използването на продуктите изисква използване на специфични устройства, те да бъдат предоставени от участника, без допълнително заплащане в рамките на предоставените продукти. | 1  2 |
| Специфични изисквания |  |
| Достъп дофинансова информация по обособена позиция 2 се трябва да бъде извършвана през един канал – публична мрежа, която да бъде достъпна в инфраструктурата на възложителя. | 1 2 |
| Функционални изисквания |  |
| * + 1. да осигури 24ч./7дни бюро за поддръжка, помощ и съдействие (help desk) за територията на Р. България, вкл. от специалист, дистанционно чрез директна линия/връзка и/или по телефон; | 1  2 |
| * + 1. да има функционалност за управление на потребителските сметки; | 1  2 |
| * + 1. да позволява директна връзка между Депозитаря на ДЦК в БНБ (ДДЦК) със системата за търговия за ценни книжа на Министерство на финансите, на която ще бъдат качени за търговия българските ДЦК, емитирани на вътрешния пазар; | 1  2 |
| * + 1. да осигури средства за мониторинг върху търговията на системата за търговия за ценни книжа (участници, емисии, обеми, котировки, цени и др.). | 1  2 |
| * + 1. Да позволява извличане на данни за много на брой параметри/инструменти чрез изпращане на файл от страна на потребителя и получаване на резултата отново във файл. | 1  2 |
| Технически изисквания |  |
| * + 1. Физически канал на доставка - Физическия канал за предоставяне на информацията и продуктите по обособена позиция 2 трябва да бъде публична мрежа, за предпочитане – интернет. | 1  2 |
| * + 1. Компютъра от който се достъпва информацията да предоставя допълнителни технически средства за автентикация, за да се осигури условието, че той се ползва само от точно определен потребител | 1 |
| * + 1. Компютъра да е достъпен за всички потребители на продукта, като всеки от тях да има отделна потребителска сметка при участника | 2 |

1. При изготвяне на техническото предложение всеки вид финансова информация по Приложение 2 трябва да бъде описан детайлно с наименование, обхват и технически параметри, които да съответстват на изискванията в настоящото приложение [↑](#footnote-ref-1)