



Контроль позиции клиента на Валютном рынке Московской биржи

Руководство пользователя

Версия 2.2



Содержание

О документе	4
1. Способы ведения позиции по валютным операциям.....	4
1.1 «Денежная» схема ведения позиции.....	4
1.2 «Инструментальная» схема ведения позиции	4
1.3 Контроль рисков на стороне биржи	5
2. Общие настройки	6
2.1 Базовые настройки Библиотеки расчета лимитов.....	6
2.2 Настройка ограничений по торгуемым инструментам	8
2.3 Ограничение контрагентов для операций в классах РПС	11
2.4 Настройка комиссионного вознаграждения	13
2.5 Ограничение на размер позиции	23
2.6 Единая денежная позиция фондового и валютного рынков	24
2.7 Кросс-курсы валют.....	26
3. Настройка «денежной» схемы ведения позиции	28
3.1 Позиции в разрезе валют.....	28
3.2 Мультивалютная позиция.....	28
3.3 Плановая позиция	29
3.4 Загрузка позиций для «денежной» схемы ведения позиции	30
3.5 Контроль рисков в «денежной» схеме ведения позиции.....	31
4. Настройка «инструментальной» схемы ведения позиции	32
4.1 Позиции в разрезе валют.....	32
4.2 Загрузка позиций для «инструментальной» схемы ведения позиции.....	32
4.3 Торговля инструментами, не содержащими в составе рубль	33
4.4 Контроль рисков в «инструментальной» схеме ведения позиции	34
4.5 Ограничение на объем операций за день	34
5. Настройка схемы без контроля позиций на сервере QUIK	38
5.1 Настройка Программного интерфейса Клиринговой системы Валютного рынка Московской Биржи	38



5.2	Настройка прав клиента	38
5.3	Настройка Библиотеки расчета лимитов.....	40
5.4	Загрузка позиций в схеме без контроля позиций на сервере QUIK.....	40
6.	Настройка маржинального кредитования	41
6.1	Использование явно заданных в настройках дисконтов	43
6.2	Использование дисконтов КЦ	43
6.3	Дополнительные опции.....	44
7.	Дополнительные режимы торгов	49
7.1	Работа со сделками по средневзвешенному курсу	49
7.2	Работа с классами урегулирования.....	53
7.3	Работа в режиме торгов фиксинга	55
7.4	Работа с классами крупных сделок	57
7.5	Работа с классом ОТС	60
7.6	Работа с классом крупных внебиржевых сделок	61
7.7	Работа с классами мелких лотов.....	64
7.8	Работа с классами RFS	66
7.8.1	Настройка Библиотеки расчета лимитов при совместном использовании Программного интерфейса RFS режима Валютного рынка Московской Биржи и Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи	67
7.8.2	Настройка Библиотеки расчета лимитов при использовании Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи без Программного интерфейса RFS режима Валютного рынка Московской Биржи	69

Ваши пожелания и комментарии к данному Руководству направляйте по электронной почта на адрес: quiksupport@argatech.com



О документе

Данный документ описывает настройки системы QUIK при организации доступа к торгам на валютном рынке Московской биржи включая основные настройки по ведению позиций клиентов, настройки маржинального кредитования и настройки списания комиссии со счета клиента. Также рекомендуем обратить внимание на содержащиеся в документе рекомендации по настройкам, защищающим от открытия недопустимо большой позиции по валюте при использовании маржинального кредитования и торговли инструментами с разными датами расчетов (см. п.6).

1. Способы ведения позиции по валютным операциям

1.1 «Денежная» схема ведения позиции

Наиболее распространенной является такая схема ведения позиции, когда валютные операции рассматриваются как конвертация валют с изменением остатков позиций по деньгам. Операция с валютной парой приводит к уменьшению денежного остатка в одной валюте и соответствующему увеличению остатка на другой. Позиция клиента в QUIK выглядит как набор остатков по деньгам.

Позиции по деньгам										
	Фирма	Валюта	Код позиции	Код клиент	Срок расчётов	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Доступно	Плечо
1	MB009990000	SUR	EQTV	99901	T0	450 000,00	450 000,00	0,00	450 000,00	
2	MB009990000	SUR	EQTV	99901	T1	450 000,00	450 000,00	0,00	450 000,00	
3	MB009990000	USD	EQTV	99901	T0	0,00	0,00	0,00	0,00	
4	MB009990000	USD	EQTV	99901	T1	0,00	0,00	0,00	0,00	

Покупка клиентом долларов в такой схеме приведет к уменьшению остатка по рублям и увеличению остатка по валюте USD.

Позиции по деньгам										
	Фирма	Валюта	Код позиции	Код клиент	Срок расчётов	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Доступно	Плечо
1	MB009990000	SUR	EQTV	99901	T0	450 000,00	384 297,50	0,00	384 297,50	
2	MB009990000	SUR	EQTV	99901	T1	450 000,00	384 297,50	0,00	384 297,50	
3	MB009990000	USD	EQTV	99901	T0	0,00	1 000,00	0,00	1 000,00	
4	MB009990000	USD	EQTV	99901	T1	0,00	1 000,00	0,00	1 000,00	

Порядок настройки контроля позиции клиента по «денежной» схеме расчетов описан п.3.

1.2 «Инструментальная» схема ведения позиции

Инструментальная схема ведения позиции клиента отображает позицию клиента в иностранной валюте как остатки по инструментам. Денежный остаток используется только для позиции в одной валюте (для Валютного рынка Московской биржи обычно это рубль). При покупке валютной пары образуется остаток по инструменту операции. Данная позиция



по инструменту может учитываться как обеспечение при совершении маржинальных операций.

Операция покупки долларов в такой схеме приведет к уменьшению денежного остатка в валюте и увеличению остатка по соответствующему валютному инструменту.

Позиции по деньгам										
	Фирма	Валюта	Код позиции	Код клиент	Срок расчётов	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Доступно	Плечо
1	MB009990000	SUR	EQTV	99901	T0	450 000,00	384 145,00	0,00	384 145,00	

Позиции по инструментам								
	Фирма	Название инструмента	Счет депо	Код клиента	Срок расчётов	Входящий остаток	Текущий остаток	Цена приобретения
1	MB009990000	USD RUB_TOD	MB0099800002	99901	T0	0	1 000	65,805

У данной схемы есть следующие особенности применения:

- неттирование позиций в одной валюте, но с разными сроками расчетов (TOD и TOM) не осуществляется;
- оценка валютных позиций (позиций в таблице «Позиции по инструментам») осуществляется по текущим рыночным ценам соответствующего инструмента.

Порядок настройки контроля позиции клиента по «инструментальной» схеме расчетов описан в п.4.

1.3 Контроль рисков на стороне биржи

В настоящий момент на Валютном рынке Московской биржи есть возможность использовать отдельные торгово-клиринговые счета, и биржа может самостоятельно контролировать риски по каждому из них. Поэтому при необходимости контроль и учет позиции на стороне сервера QUIK может быть отключен, позиция клиента будет транслироваться клиенту с самой биржи в таблицу «Позиций участника по деньгам» Рабочего места QUIK.

Позиции участника по деньгам									
	Фирма	Валюта	Код позиции	Идентификатор счета	Описание	Входящий	Текущий	Плановый	Расчетная
63	MB009990000	USD	USSD	50118	USD/RUB_SPT - USD	0,00	0,00	0,00	0,00
64	MB009990000	RUB	USSR	50118	USD/RUB_SPT - RUB	0,00	0,00	0,00	0,00
65	MB009990000	USD	USWD	50118	USD/RUB_FWD - USD	0,00	0,00	0,00	0,00
66	MB009990000	RUB	USWR	50118	USD/RUB_FWD - RUB	0,00	0,00	0,00	0,00
67	MB009990000	UAH	UTSA	50118	Средства - UAH	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
68	MB009990000	BYN	UTSB	50118	Средства - BYN	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
69	MB009990000	CNY	UTSC	50118	Средства - CNY	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
70	MB009990000	EUR	UTSE	50118	Средства - EUR	1 001 000 000,00	1 001 000 000,00	1 001 000 000,00	1 001 000 000,00
71	MB009990000	GLD	UTSG	50118	Средства - GLD	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
72	MB009990000	HKD	UTSH	50118	Средства - HKD	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
73	MB009990000	TRY	UTSI	50118	Средства - TRY	0,00	0,00	0,00	0,00
74	MB009990000	KZT	UTSK	50118	Средства - KZT	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
75	MB009990000	RUB	UTSL	50118	Единый лимит	2 584 627 330 293,30	2 584 627 330 293,30	2 584 627 330 293,30	2 584 627 330 293,30
76	MB009990000	GBP	UTSP	50118	Средства - GBP	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
77	MB009990000	RUB	UTSR	50118	Средства - RUB	924 929 151,30	924 929 151,30	924 929 151,30	924 929 151,30
78	MB009990000	SLV	UTSS	50118	Средства - SLV	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
79	MB009990000	USD	UTSU	50118	Средства - USD	1 000 014 000,00	1 000 014 000,00	1 000 014 000,00	1 000 014 000,00

В дополнение контролю рисков со стороны торговой системы можно настроить контроль позиции со стороны QUIK. Таким образом, данная схема может сочетаться с другими схемами контроля рисков на сервере QUIK.

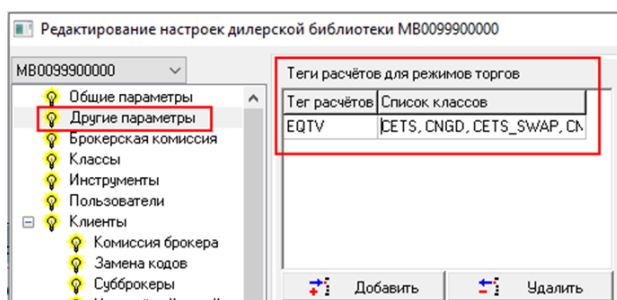
Настройки для использования данной схемы приведены в п.5.



2. Общие настройки

2.1 Базовые настройки Библиотеки расчета лимитов

Вне зависимости от выбранной схемы ведения позиции коды торговых классов, в которых будут осуществляться торговые операции, необходимо привязать к выбранному тегу расчетов (коду позиции). Привязка осуществляется в настройках Библиотеки расчета лимитов на странице «Другие параметры» в настройке «Теги расчётов для режимов торгов».



На текущий момент на Валютном рынке Московской Биржи доступно совершение операций в следующих классах:

Код	Наименование
CETS	МБ Валюта: Системные сделки
CETS_SWAP	МБ Валюта: Системные сделки (SWAP)
CNGD	МБ Валюта: РПС
CNGD_SWAP	МБ Валюта: РПС (SWAP)
CETS_MTL	МБ Валюта: Металлы
CNGD_MTL	МБ Валюта: РПС: Металлы
FUTS	МБ Валюта: Фьючерсы
FUTN	МБ Валюта: РПС: Фьючерсы
SHFT	МБ Валюта: Перенос исполнения сделок
FIXS	МБ Валюта: Фиксинг
FIXN	МБ Валюта: РПС: Фиксинг
LICU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования
LICU_SWAP	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (SWAP)

LICU_MTL	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (Металлы)
WAPN	МБ Валюта: Внесистемные средневзвешенные
WAPS	МБ Валюта: Системные средневзвешенные
AUCB	МБ Валюта: Аукцион с ЦБ РФ
SDBP	МБ Валюта: Крупные сделки
AETS	МБ Валюта: Дополнительная сессия
AETS_SWAP	МБ Валюта: Дополнительная сессия (SWAP)
CETS_SU	МБ Валюта: ETC (Центы)
CNGD_SU	МБ Валюта: РПС (Центы)
CNGDSWAP_SU	МБ Валюта: РПС (SWAP) (Центы)
LICU_SU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (Центы)
LICUSWAP_SU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (СВОПЫ) (Центы)
OTCT	МБ Валюта: Рынок OTC
OTCF	МБ Валюта: Крупные внебиржевые сделки
RFSP	МБ Валюта: Внебиржевые котировки RFS
RFSM	МБ Валюта: Внебиржевые сделки RFS

Для выделения СВОП в отдельные классы CETS_SWAP, CNGD_SWAP, LICU_SWAP обратитесь за инструкцией в Службу технической поддержки QUIK по адресу quiksupport@arqatech.com.

В настройке достаточно указать только те классы, по которым будут совершаться операции.

Для работы в классах с кодами FIX*, LIC*, WAP* и SDBP требуются дополнительные настройки сервера QUIK, описанные в п. 7.

Привязку классов рекомендуем осуществить к тегу расчетов (коду позиции) EQTV, который используется по умолчанию в ряде настроек.

Для того, чтобы установка позиций по деньгам на тег расчетов (код позиции) EQTV (и другие теги) и валюты была доступна, необходимо в настройках Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи (в файле AstsCurrGate.ini) выполнить настройку:

```
[AddTag]
<Код фирмы>,<код валюты>=<Список кодов позиций, разделенных символом «,» (запятая)>
```



Где вместо значения <Код фирмы> укажите Ваш идентификатор фирмы, например:

```
[AddTag]
MB0099900000=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,USD=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,EUR=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,CNY=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,BYN=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,HKD=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,GBP=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,TRY=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,CHF=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,JPY=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,KZT=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,GLD=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
MB0099900000,SLV=EQTV, EQTS, RTOD, RTOM
```

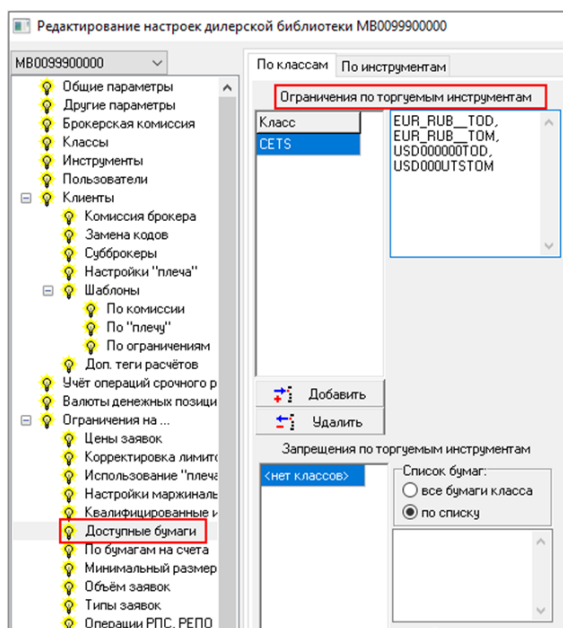
Для каждой пары <код фирмы>, <код валюты> Интерфейс генерирует нулевую денежную позицию для указанных кодов позиций. Такие позиции содержат описание «technological». Если код валюты не задан, используется «SUR».

2.2 Настройка ограничений по торгуемым инструментам

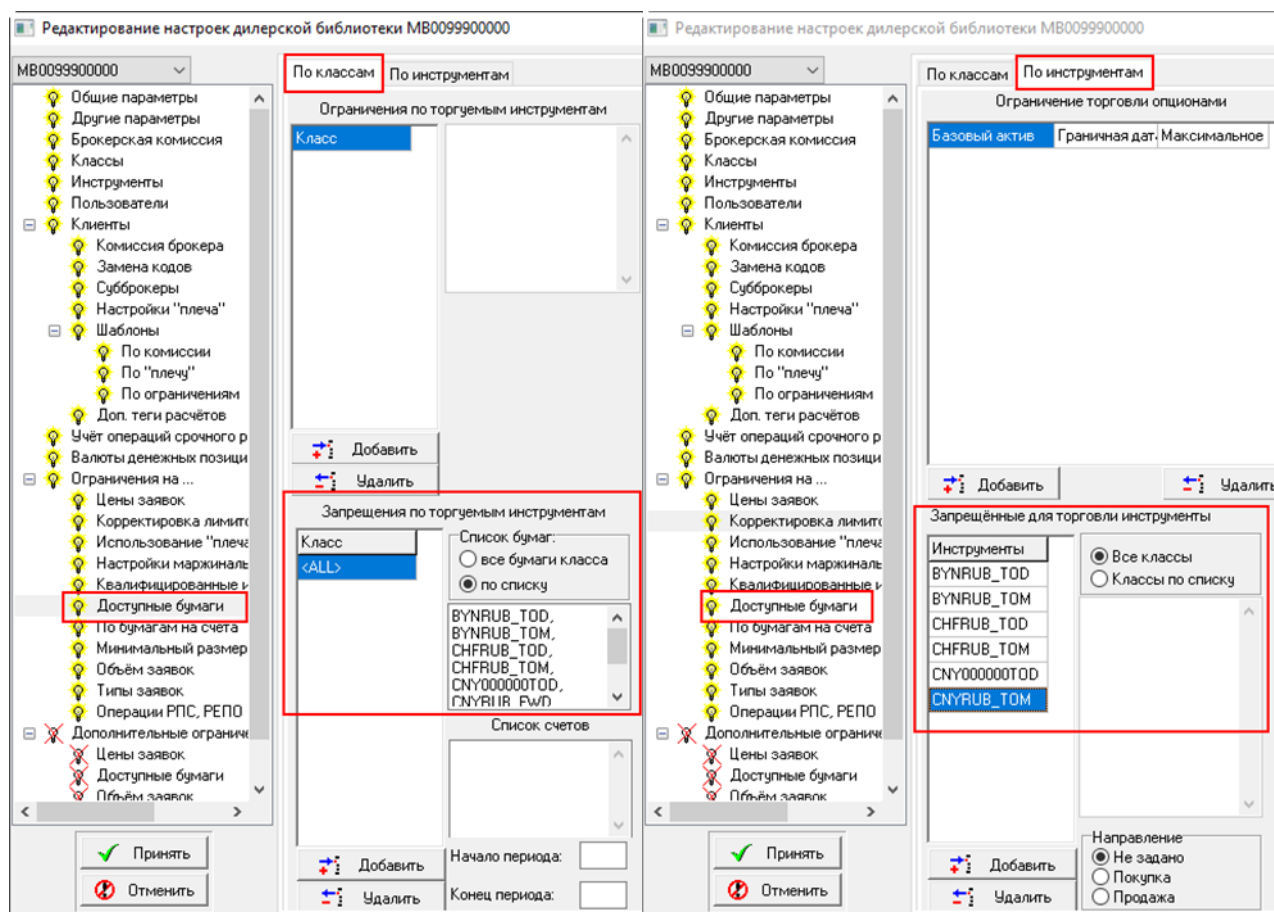
Стандартные ограничения Библиотеки расчета лимитов позволяют решить задачу ограничения числа доступных инструментов для совершения операций.

- Настройка списка разрешенных инструментов выполняется на странице «Ограничения на .../ Доступные бумаги» в настройке «Ограничения по торгуемым инструментам». Инструменты класса, неуказанные в списке разрешенных, будут автоматически запрещены для торговли.





- Настройка списка запрещенных инструментов выполняется на странице «Ограничения на ... / Доступные бумаги» на вкладке «По классам» в настройке «Запрещения по торгуемым инструментам», а также на вкладке «По инструментам» в настройке «Запрещённые для торговли инструменты».



Описанные выше настройки являются глобальными и распространяются на всех клиентов. Если необходимо настроить ограничение по инструментам только для некоторых клиентов, то настройка выполняется в следующих разделах Библиотеки расчета лимитов:

- раздел «Клиенты / Комиссия брокера», вкладки «Разрешения по классам» и «Запрещения по классам»;
- раздел «Шаблоны / По комиссии», вкладки «Разрешения по классам» и «Запрещения по классам»;
- раздел «Шаблоны / По ограничениям», вкладки «Разрешения по инструментам» и «Запрещения по инструментам»;

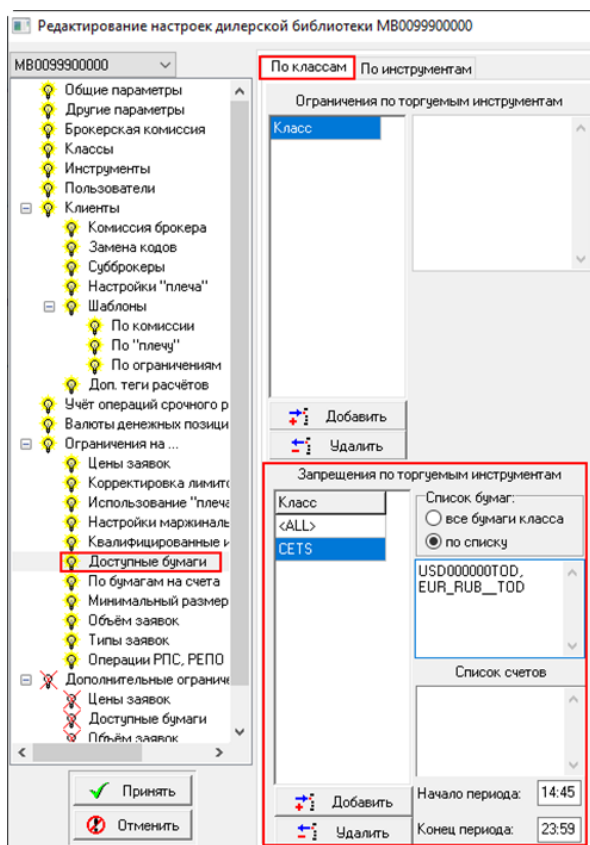
Особенность торгов на Валютном рынке Московской биржи состоит в том, что торговля инструментами с поставкой «сегодня» (TOD) завершается раньше, чем инструментами с расчетами на следующий торговый день (TOM).

Время, доступное для совершения операций с валютными инструментами, указано во временном регламенте биржи, который доступен по ссылке: <https://fs.moex.com/files/710/32947>.

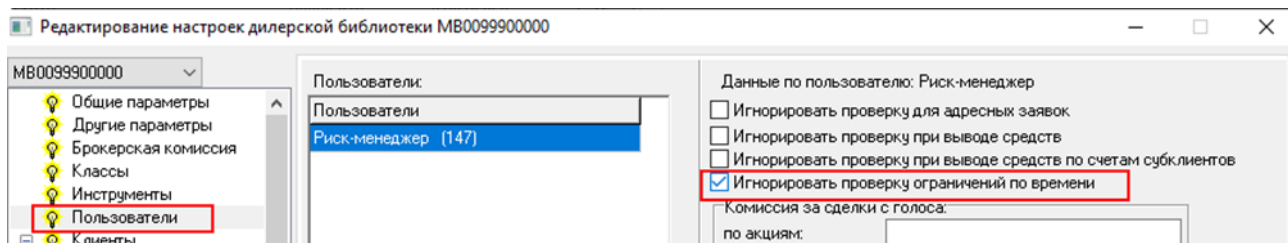
В связи с этим, для того чтобы у риск-менеджера было время на перенос задолженностей по позициям клиентов с расчетами сегодня, можно воспользоваться функцией запрета торговли инструментами с поставкой «сегодня» за некоторое количество времени до окончания торгов по данным инструментам.

Настройка ограничений по времени выполняется на странице «Ограничения на... / Доступные бумаги» на вкладке «По классам» в настройке «Запрещения по инструментам». Время действия ограничения настраивается в полях «Начало периода» и «Конец периода».





Для отдельных пользователей (например, риск-менеджеров, которым нужно в запрещенное время осуществлять перенос позиций клиентов) можно настроить игнорирование данных ограничений на странице «Пользователи» при помощи настройки «Игнорировать проверку ограничений по времени»



Подробно данные настройки описаны в Руководстве по администрированию настроек Библиотеки расчета лимитов.

2.3 Ограничение контрагентов для операций в классах РПС

Ограничения на выставление заявок в классах РПС (CNGD*) на доступных контрагентов настраиваются на странице «Ограничения на... / Операции РПС, РЕПО» в настройке «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента».



Для того, чтобы запретить заключение сделок с определенными контрагентами, в настройке «Запрещенные контрагенты / Запрещенные коды» выберите значение «по списку» и в поле ниже укажите через запятую коды фирм контрагентов:

Редактирование настроек дилерской библиотеки MB0099900000

MB0099900000

Операции РПС, РЕПО Настройки РПС, РЕПО по классам

Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета

Разрешенные коды расчетов Запрещенные коды расчетов

Разрешенные коды: ☐ все коды расчетов ☒ по списку

Запрещенные коды: ☐ все коды расчетов ☒ по списку

Ограничения операций РПС, РЕПО по коду контрагента

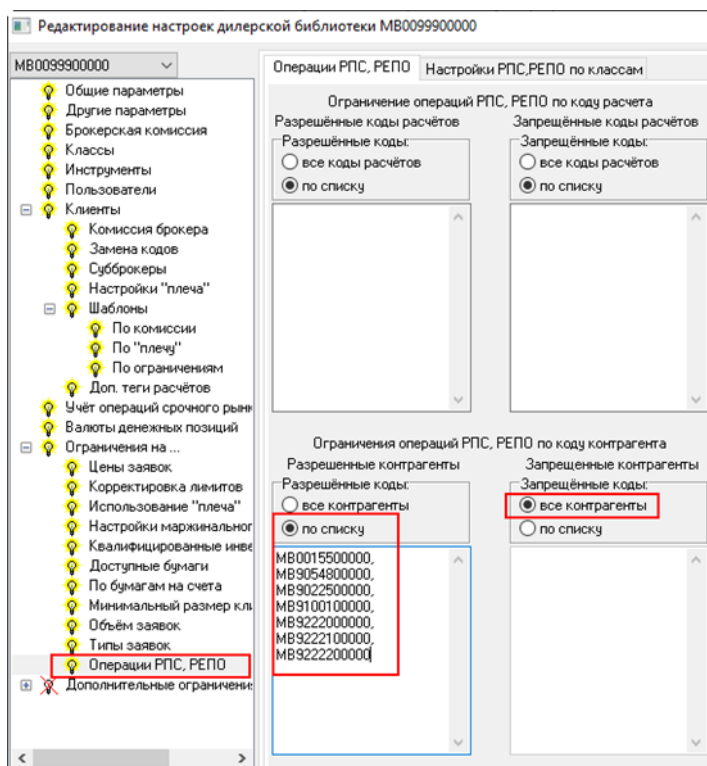
Разрешенные контрагенты Запрещенные контрагенты

Разрешенные коды: ☐ все контрагенты ☒ по списку

Запрещенные коды: ☐ все контрагенты ☒ по списку

MB9033700000,
MB9035500000,
MB9015700000,
MB9015800000,
MB0099800000

Для того, чтобы разрешить заключение сделок с определенными контрагентами, в настройке «Запрещенные контрагенты / Запрещенные коды» выберите значение «все контрагенты», а в настройке «Разрешенные контрагенты / Разрешенные коды» выберите значение «по списку» и в поле ниже укажите через запятую коды фирм контрагентов:



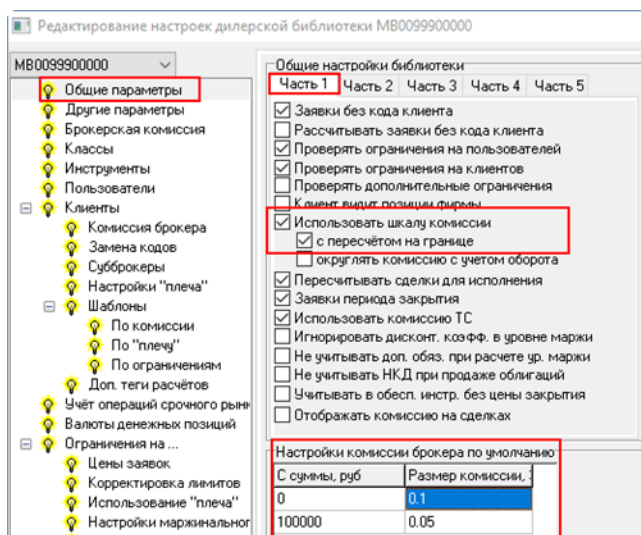
2.4 Настройка комиссионного вознаграждения

Для операций на валютном рынке могут быть настроены те же виды комиссии, что и для фондового рынка, в том числе комиссия по шкале. Ниже в качестве примера приведен порядок настройки основных типов комиссий: фиксированной и по шкале. Остальные типы комиссии, например, «за сделку» могут быть настроены аналогичным образом.

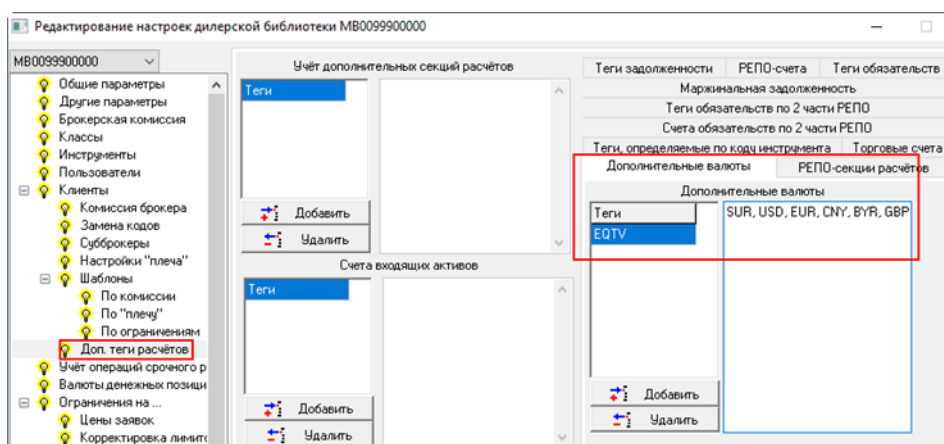
Настройки брокерской комиссии по шкале

Для настройки брокерской комиссии по шкале нужно выполнить следующие действия:

- на странице «Общие параметры» на вкладке «Часть 1» включите опцию «Использовать шкалу комиссии»;
- при необходимости включите настройку «с пересчетом на границе»;
- задайте ставки комиссии в зависимости от оборота операций в настройке «Настройка комиссии брокера по умолчанию».



ВАЖНО!!! Для корректного расчета брокерской комиссии по шкале и учета минимального размера брокерской комиссии по конверсионным операциям на валютном рынке с «денежной» схемой контроля позиции требуется включение объединения валютных позиций через настройку «Клиенты / Доп.теги расчетов / Дополнительные валюты». В данной настройке должны быть указаны через запятую все валюты, по которым у клиентов могут возникнуть позиции. Тег расчетов (код позиции) указывается тот же, что в настройке «Теги расчетов для режимов торгов», выполненной в п.2.1.

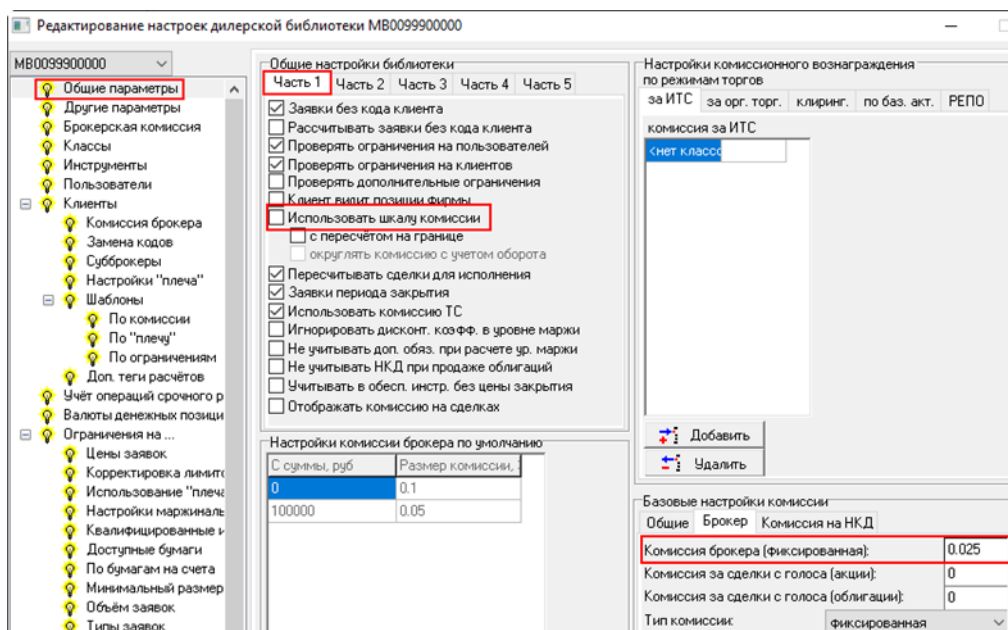


Настройка фиксированной брокерской комиссии

Для настройки брокерской комиссии в размере заданного фиксированного процента от объема сделки комиссии:

- на странице «Общие параметры / Часть 1» отключите опцию «Использовать шкалу комиссии»;
- задайте процент фиксированной комиссии на странице «Общие параметры / Базовые настройки комиссии» вкладке «Брокер» настройке «Комиссия брокера (фиксированная)».

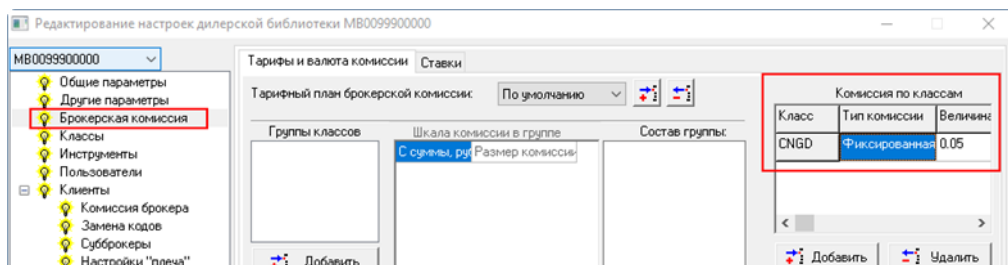




Комбинированная комиссия

В случае если по каким-то классам нужно списывать комиссию по шкале, а по другим фиксированный процент, то:

- выполните настройки, описанные в п. 2.4.1;
- на странице «Брокерская комиссия» в настройку «Комиссия по классам» добавьте классы, к которым должен применяться фиксированный процент комиссии и в колонке «Тип комиссии» укажите значение «Фиксированная», а в колонке «Величина» величину процента комиссии.



Учет комиссии торговой системы

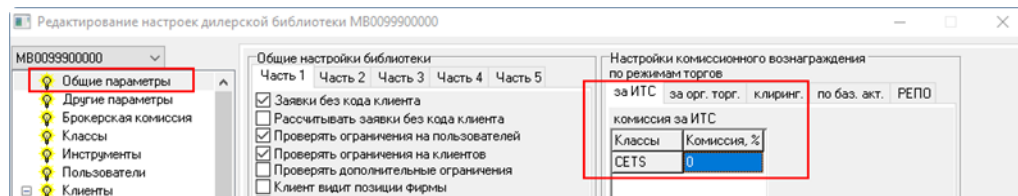
При выставлении заявки сервер QUIK проверяет покупательную способность с учетом комиссии брокера и торговой системы. До заключения сделки QUIK не знает, какая комиссия по сделке будет списана в торговой системе. Поэтому QUIK производит расчет и блокировку средств под комиссию исходя из значений комиссии торговой системы по умолчанию и выполненных настроек в Библиотеке расчета лимитов.

Тарифы биржи доступны по ссылке: <https://fs.moex.com/files/8846>.

На основании данных тарифов в сервере QUIK сформированы значения комиссий торговой системы по умолчанию.



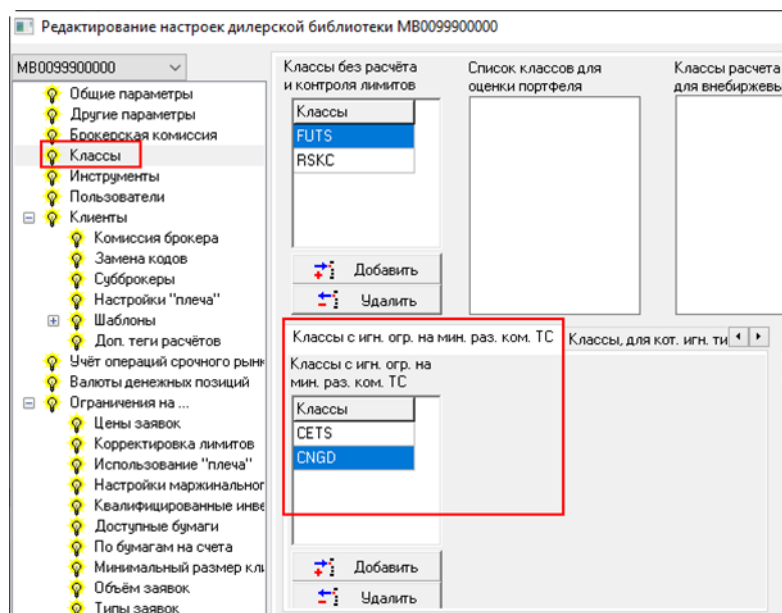
Размер значений по умолчанию можно переопределить в настройках Библиотеки расчета лимитов на странице «Общие параметры» в разделе «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» на вкладках «за орг. торг.», «клиринг.». В частности, можно отключить проверку комиссии торговой системы, если она не должна списываться по операциям с остатка клиента.



Дополнительно на Валютном рынке Московской биржи имеется минимальная фиксированная ставка комиссионного вознаграждения в размере 50 рублей по сделкам, совершенным из заявок с количеством менее 50 лотов и 1 рубль за сделку по заявке от 50 лотов и классов РПС.

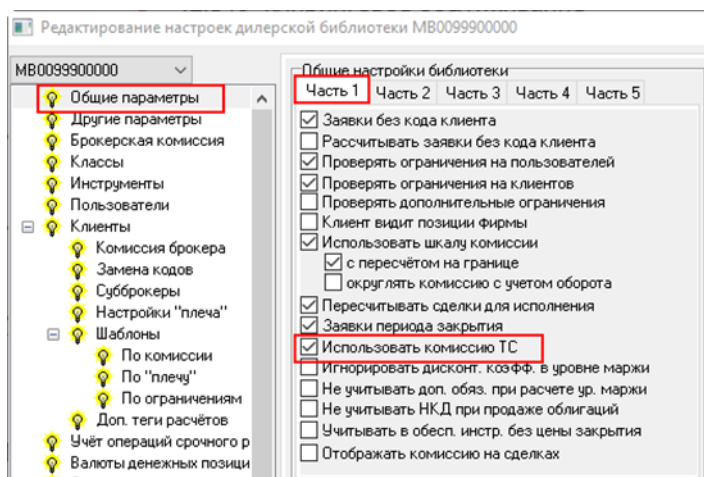
При этом блокировка производится из сценария наихудшего исполнения – сделками по одному лоту. Таким образом, для заявки на 20 лотов минимальная комиссия торговой системы при проверке заявки составит $20 \times 50 = 1000$ рублей.

При необходимости, учет данной минимальной комиссии может быть отключен на странице «Классы» в настройке «Классы с игн. огр. на мин. раз. ком. ТС». Для этого нужно добавить в данную настройку классы, минимальную комиссию торговой системы для которых нужно отключить.



Комиссия торговой системы блокируется при подаче заявки и списывается при заключении сделки.

Размер списываемой по сделке комиссии торговой системы зависит от состояния настройки «Общие параметры / Часть 1 / Использовать комиссию ТС».



- Если настройка включена, то при заключении сделки списывается комиссия в размере значения поля «Комиссия ТС» в Таблице сделок Рабочего места QUIK.

	Номер	Время	Период	Заявка	Инструмент	Операция	Счет	Цена	Кол-во	Объем	Комментарий	Комиссия ТС
1	342 521 601	9:37:52	Нормальный	1 619 467 592	USDRUB_TOM	Купля	MB0099800001	66,1150	51	3 371 865,00	99901/	50,58

- Если настройка выключена, то при заключении сделки списывается комиссия в размере, рассчитываемом сервером QUIK.

При этом можно отметить возможность отключения трансляции комиссии торговой системы на сделке на уровне Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи (AstsCurrGate). За это отвечает настройка SendTradeCommission в секции [Behavior] в файле AstsCurrGate.ini.

Если SendTradeCommission=0, то трансляция комиссии торговой системы на сделках не осуществляется. И при включенной в настройках Библиотеки расчета лимитов опции «Использовать комиссию ТС» комиссия торговой системы при заключении сделок с остатков клиентов списываться не будет.

Если SendTradeCommission=1 (значение по умолчанию), то комиссия торговой системы на сделках транслируется, и, если включена настройка «Использовать комиссию ТС» в настройках Библиотеки расчета лимитов присланное биржей значение списывается с остатков клиентов.

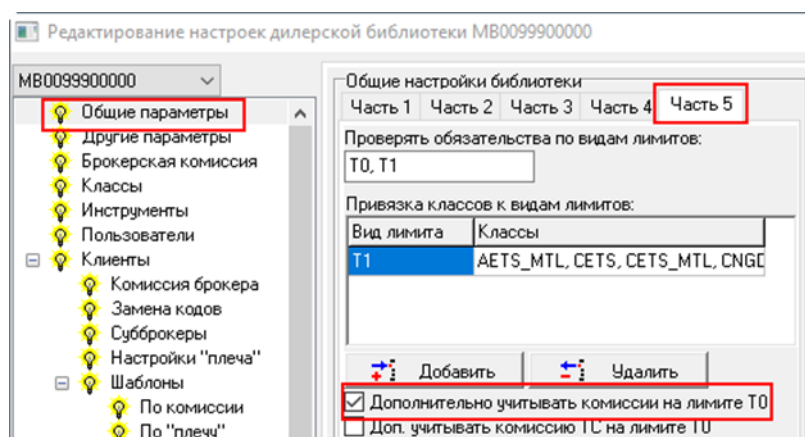
Дополнительно существует возможность отключать/включать трансляцию комиссии торговой системы в разрезе классов. Более подробную информацию о данной настройке можно найти в руководстве по администрированию Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи.

Дополнительно учитывать комиссии на лимите T0

В некоторых случаях брокеру необходимо списывать с клиентов комиссию по сделкам со сроком расчетов, отличным от TOD, сразу при их совершении, а не в момент расчетов по данным сделкам. Для этого в настройках Библиотеки расчета лимитов можно настроить списание комиссии по сделкам с расчетами T+ с вида лимита T0, включив опцию «Общие



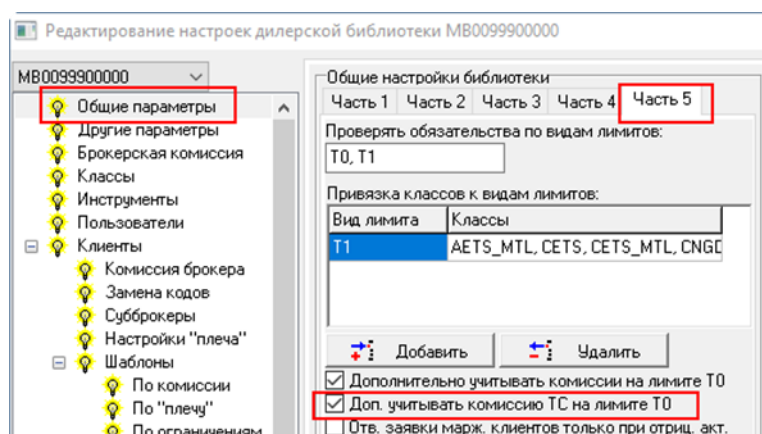
параметры / Часть 5 / Дополнительно учитывать комиссии на лимите T0». В этом случае с T0 будет списываться комиссия брокера и торговой системы.



Дополнительно существуют опции, которые определяют, как проверять комиссию.

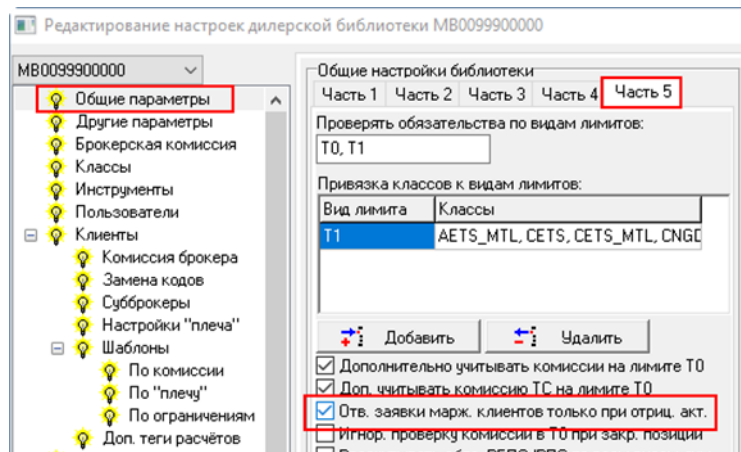
Опция «Дополнительно учитывать комиссию ТС на лимите T0»

Для того, чтобы с видов лимитов меньших чем срок расчетов по сделке списывать только комиссии торговой системы без учета комиссии брокера, включите опцию «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите T0»



Настройка имеет меньший приоритет чем «Дополнительно учитывать комиссии на лимите T0».

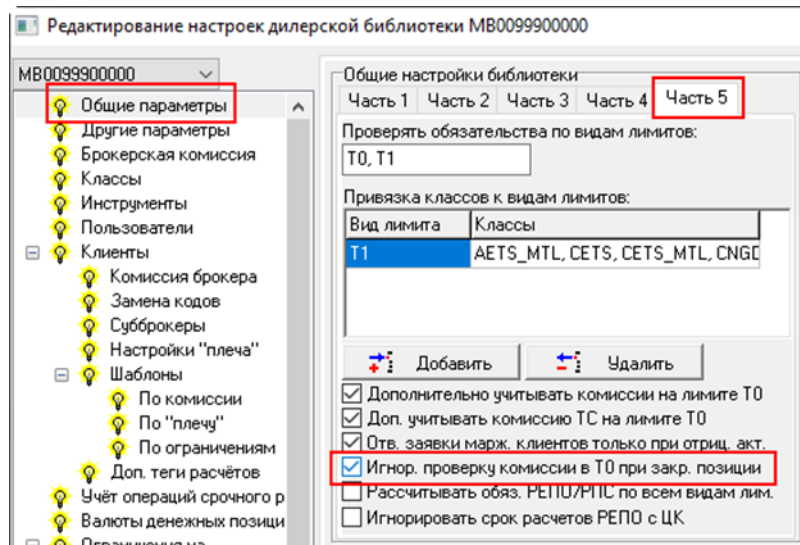
Опция «Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах»



При включенной настройке заявки будут отвергаться в том случае, если с учетом комиссии по выставляемой заявке оценка стоимости портфеля (текущих активов) клиента, на виде лимитов на котором проверяется списание комиссии, становится отрицательной.

При отключенной настройке для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» проверяется, что значение скорректированной маржи не превышает значение стоимости портфеля, а для клиентов с типом кредитования «МД+» проверяется, что значение скорректированного значения НПР1 не станет отрицательным.

Опция «Игнорировать проверку комиссии в T0 при закрытии позиции»



При включенной настройке отключается проверка достаточности средств на видах лимитов проверки списания комиссии для заявок, сокращающих размер позиции по модулю. При этом блокировка комиссии по заявке и ее списание по сделке все равно выполняется.

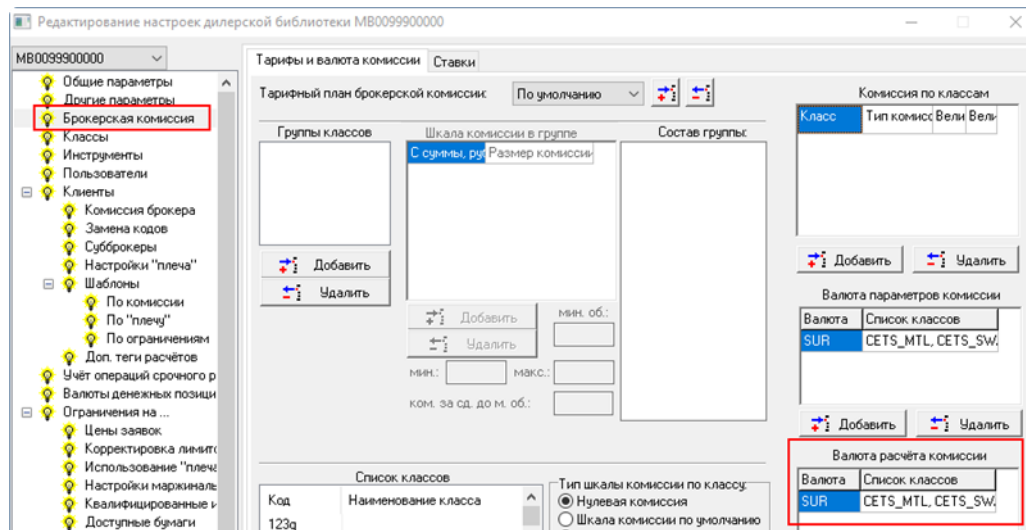
При этом если данная опция не включена, а опция «Дополнительно учитывать комиссии на лимите T0» включена, то логика, при которой клиент всегда может закрыть свою позицию, не работает. Например, если у клиента есть бумага в T2, но нет денег в T0, то продать

данную бумагу в рамках остатка клиент не сможет, так как у него нет средств под уплату комиссии.

Валюта учета комиссий

Валюта расчёта комиссии

На Валютном рынке Московской биржи комиссия торговой системы всегда транслируется в рублях. Для того чтобы сервер QUIK правильно производил учет комиссии торговой системы необходимо классы валютного рынка добавить в настройку «Брокерская комиссия / Валюта расчета комиссии», где в поле «Валюта» указать SUR.



Валюта списания комиссии

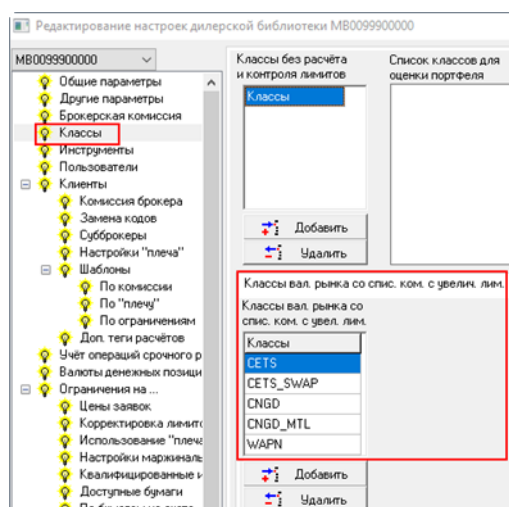
Брокерская комиссия и комиссия торговой системы рассчитываются в валюте расчетов сделки (параметр «Котируемая валюта» в Таблице текущих торгов Рабочего места QUIK). Если валюта инструмента (параметр «Валюта» в Таблице текущих торгов Рабочего места QUIK) отличается от валюты расчетов, то рассчитанная величина комиссии умножается на кросс-курс к данной валюте и учитывается в полученном размере на остатке клиента в валюте инструмента.

Текущая таблица параметров (валюта)			
Код инструмента	Базовая валюта	Валюта	Котир.валюта
BYNRUB_TOD	BYN	SUR	RUB
BYNRUB_TOM	BYN	SUR	RUB
CHFRUB_TOD	CHF	SUR	RUB
CHFRUB_TOM	CHF	SUR	RUB
CNYRUB_FWD	CNY	SUR	RUB
CNYRUB_SPT	CNY	SUR	RUB
CNY000000TOD	CNY	SUR	RUB
CNYRUB_TOM	CNY	SUR	RUB
EURRUB_FWD	EUR	SUR	RUB
EURRUB_SPT	EUR	SUR	RUB
EURRUB_TDB	EUR	SUR	RUB
EURRUB_TMB	EUR	SUR	RUB
EURRUB_TOD	EUR	SUR	RUB

Для того чтобы списывать комиссию в валюте отличной от котируемой валюты, необходимо сделать настройку для класса, указав с какой валюты списывать комиссию. Настройка выполняется на странице «Брокерская комиссия / Валюта списания комиссии».



Для выполнения настройки необходимо классы валютного рынка добавить на странице «Классы» на вкладку «Классы вал. рынка со спис. ком. с увелич. лим.»:



Настройка используется только для денежной валютной схемы, и работает только с типами комиссии «Фиксированная комиссия» и «Max(сдел., фикс.)» и не работает со шкалой комиссии.

При использовании данной опции класс не должен быть добавлен в настройку «Валюта списания комиссии», так как эта настройка имеет больший приоритет, чем настройка «Классы вал. рынка со спис. ком. с увелич. лим.».

Пример расчета комиссии по операции покупки

Остатки клиента до сделки:

Валюта	Остаток
SUR	65000
USD	0

Клиент покупает 1 000 USD 64 000 SUR, комиссия брокера 0,1%, комиссия торговой системы 25 SUR.

У клиента будет списано 64 000 SUR и зачислено

$1\,000 - (1\,000(\text{объем сделки}) \cdot 0,1\%(\text{комиссия брокера}) + 25(\text{комиссия ТС}) / 64) =$
 $= 1\,000 - 1,39 = 998,61 \text{ USD}$, т.е. за сделку комиссия будет списана в размере 1,39 USD.

Остатки клиента после сделки:

Валюта	Остаток
SUR	1000
USD	998,61



Клиент продает 1 000 USD за 64 000 SUR, комиссия брокера также 0,1% и комиссия торговой системы 25 SUR.

У клиента будет списано 1 000 USD и зачислено

$64\,000 - (64\,000(\text{объем сделки}) * 0,1\%(\text{комиссия брокера}) - 25(\text{комиссия ТС})) = 64\,000 - 89 = 63\,911$ SUR комиссия будет списана в размере 89 SUR за такую сделку.

Остатки клиента после сделки:

Валюта	Остаток
SUR	63911
USD	0

2.5 Ограничение на размер позиции

Для ограничения позиции по валюте для денежной схемы расчетов и позиции по инструментам в «инструментальной» схеме используется настройка «Ограничение максимального размера позиции», которая находится на странице «Ограничения на ... / Объем заявок» для настройки ограничения для всех клиентов и на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям» вкладке «Ограничения позиции» для настройки для некоторых клиентов.

Настройка позволяет задать ограничения максимального размера позиции в разрезе инструментов для длинных и коротких позиций.

Ограничения в данной настройке переопределяют ограничения из глобальной настройки на странице «Ограничения на... / Объем заявок».

Ограничения данной настройки не проверяются при выполнении операции закрытия позиции.

Допустимо указание только одного из параметров «Огр. длин. поз.» или «Огр. корот. поз.». Для неуказанного параметра ограничения не будет.

Пример настройки для «денежной» схемы:

Ограничение максимального размера позиции		
Инструменты	Огр. длин. поз.	Огр. корот. поз.
EUR		15000
USD	1500000	100000

Пример настройки для «инструментальной» схемы:



Ограничение максимального размера позиции		
Инструменты	Огр. длин. поз.	Огр. корот. поз.
EUR_RUB_TOD		15000
EUR_RUB_TOM		15000
USD000000TOD	150000	10000
USD000000TOM	10000	

2.6 Единая денежная позиция фондового и валютного рынков

Для настройки Единой денежной позиции для фондового и валютного рынков осуществляется перевод работы Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи (AstsCurrGate) и Программного интерфейса Клиринговой системы Валютного рынка Московской Биржи AstsCurrRiskGate (если используется) на работу от фирмы, от которой работает Торговый интерфейс Фондового рынка Московской Биржи (AstsGate). Т.е. работа на двух рынках в QUIK будет осуществляться от «единой» фирмы.

Настройка Торгового и Клирингового интерфейсов

Настройка выполняется в файлах настроек AstsCurrGate.ini (AstsCurrRiskGate.ini). В секцию [Exchange] добавляется параметр QUIKFIRMID со значением кода фирмы на фондовом рынке.

Например:

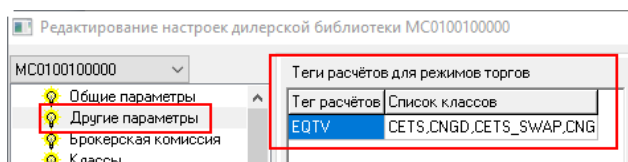
```
[Exchange]
FIRMID=MB0099900000
QUIKFIRMID=MC0099900000
```

После осуществления данной настройки нужно учесть следующие изменения:

- все позиции по валютному рынку требуется загружать с кодом фирмы фондового рынка;
- все учетные системы, получающие данные через QUIK, будут получать заявки/сделки и прочую информацию с кодом фирмы фондового рынка;
- в правах пользователей по классам валютного рынка и классу кросс-курсов с кодом CROSSRATE должна быть указана фирма фондового рынка.

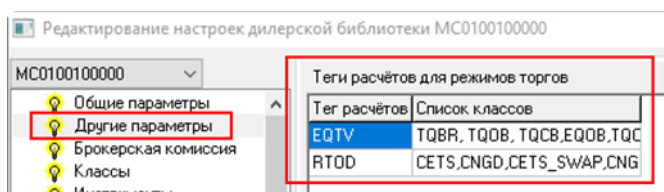
Изменение настроек Библиотеки расчета лимитов

Если Единая денежная позиция необходима для всех клиентов, то откройте на редактирование настройки Библиотеки расчета лимитов для фирмы фондового рынка и на странице «Другие параметры» в настройку «Теги расчётов для режимов торгов» добавьте перечень кодов классов на валютном рынке (CETS, CNGD и остальные) к существующему тегу расчетов (коду позиции):



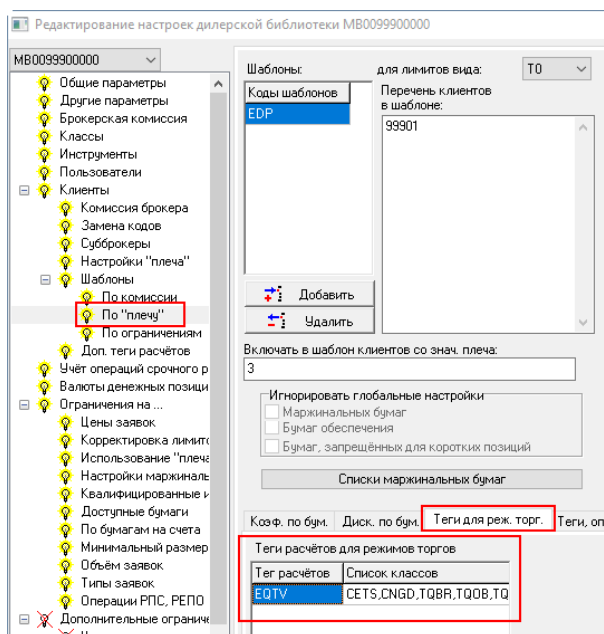
Денежный остаток в рамках единой позиции может быть использован на любом из рынков. Например, клиент может потратить свой остаток по рублям как на покупку акций на фондовом рынке, так и на покупку валюты.

Если Единая денежная позиция необходима для части клиентов, то откройте на редактирование настройки Библиотеки расчета лимитов для фирмы фондового рынка и на странице «Другие параметры» в настройку «Теги расчётов для режимов торгов» добавьте перечень кодов классов на валютном рынке (CETS,CNGD и др.) к новому тегу расчетов (коду позиции) (например, RTOD):



Выбранный тег должен транслироваться в таблицу «Позиции участника по деньгам» в колонке «Код позиции». Данная таблица доступна менеджерам с установленными правами «Класс доступен», «Заявки» и «Сделки». Если тег, выбранный для учета операций валютного рынка, отсутствует в данной таблице, то обратитесь за дополнительной настройкой в Службу технической поддержки QUIK по адресу quiksupport@arqatech.com.

Для организации Единой денежной позиции для части клиентов выделите этих клиентов в отдельный шаблон «по плечу» и на вкладке «Теги для реж.торгов» укажите тег расчетов (код позиции), к которому привязаны классы фондового рынка в настройке «Другие параметры / Теги расчетов для режимов торгов», и укажите для него список классов фондового и валютного рынков через запятую:



2.7 Кросс-курсы валют

Для работы на валютном рынке необходимы кросс-курсы, которые используются для оценки рисков. Для «денежной» схемы ведения позиций и «инструментальной» схемы с настроенной торговлей валютными парами, не содержащими рубль, наличие кросс-курсов является строго обязательным. Можно выделить 2 источника курсов валют для сервера QUIK: статические и динамические.

Статические кросс-курсы

Задаются в файле `crossrate.ini`, расположенном в директории с сервером QUIK.

Актуальные значения курсов валют, которые будут использоваться сервером, могут быть заданы в файле самостоятельно в нужных величинах. Также можно использовать файл с кросс-курсами Центрального Банка, который доступен для скачивания с нашего FTP (обновляется каждый день до начала торгов) по ссылке:

ftp://ftp.quik.ru/public/Archives/crossrate_cbr.ini

После скачивания скопируйте файл в директорию с сервером QUIK.

Динамические кросс-курсы

Используются для оценки валютных рисков портфеля по текущим рыночным ценам внутри дня. Для этого может быть использован Модуль формирования кросс-курсов. Более подробная информация о модуле доступна по ссылке:

<https://arqatech.com/ru/products/quik/modules/infrastructure-solutions/cross-currency-rates/>

В качестве курса валюты может быть использована цена последней сделки заданного валютного инструмента.



Для корректного расчета портфеля пользователям необходимы права по классу кросс-курсов с кодом CROSSRATE. Права могут быть установлены аналогично правам пользователя на других валютных классах. Например, для пользователя с правами клиента нужно устанавливать код валютной фирмы по этому классу и указывать код клиента.

Общие права | Безопасность | **Права по классам** | Операции

☒ Классы
 ☐ Рынки
 ☐ С правами
 ☒ Все

Код класса	Наименование класса	Рынок	Роль	Код фирмы	Код у дилера	Кол-во
CROSSRATE	Кросс-курсы валют	МБ Валютный	Клиент	MB0099900000		1

Шаблон прав:

Код фирмы:

☒ Класс доступен
 ☒ Расширенные параметры
 ☒ Котировки
 ☐ Обезличенные сделки
 ☒ Клиент фирмы
 ☒ Заявки
 ☒ Сделки
 ☐ Стоп-заявки
 ☐ Перенос стоп-заявок
 ☐ Работа со справочником инструментов
 ☐ Дополнительная информация по котировкам
 ☐ Двусторонние котировки
 ☐ Отображение наименования класса

☒ Активные операции
 ☐ Работа с подтверждениями
 ☐ Рыночные заявки на покупку
 ☐ Заявки "До отмены"
 ☐ Игнорировать примечание
 ☐ Подпись файлов не обязательна
 ☐ Специальные операции
 ☐ Субадминистратор

☐ Установка лимитов только по деньгам
 ☐ Торговый субадминистратор
 ☐ Только изменение плеча
 ☐ Запрос цены у дилера

☐ Установка лимитов
 ☐ Только просмотр лимитов
 ☐ Денежные позиции брокера
 ☐ Позиции брокера по бумагам
 ☐ Просмотр заявок, сделок по фирме брокера
 ☐ Просмотр по всем брокерам
 ☐ Показывать клиентские ошибки
 ☐ Подтверждение заявок клиентов
 ☐ Игнорировать отсутствие лимитов
 ☐ Установка кросс-курсов для OMS
 ☐ Процентная ставка по операциям SWAP
 ☐ Инверсия списка: перечисленные коды запрещены

Коды клиентов у дилера (через,):

Кодов в списке: 1

Проверить доступность кросс-курсов валют можно в Рабочем месте QUIK, добавив класс кросс-курсов в Таблицу текущих торгов и добавив параметр «Курс».

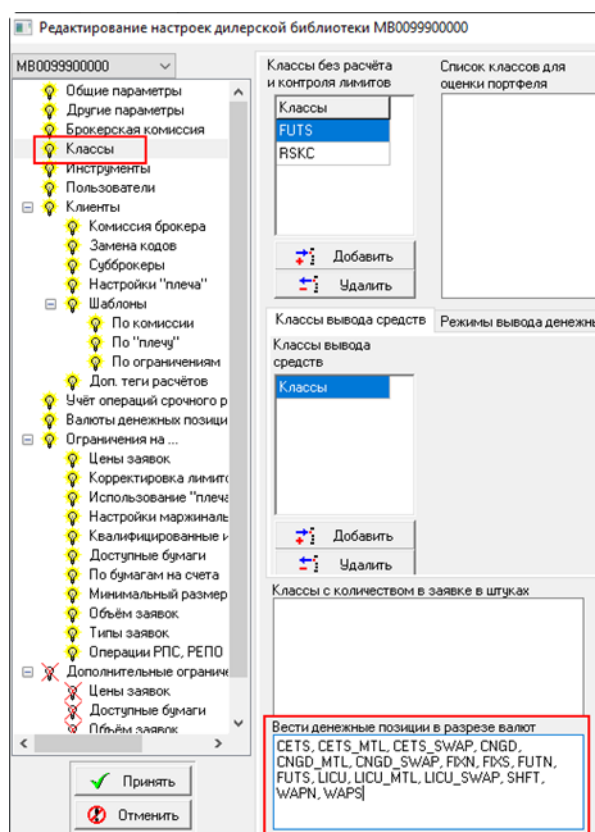
Текущие торги (CROSSRATE)	
Код инструмента	Курс
GBX	1,0280
GBP	102,8000
CNY	11,1169
EUR	70,9023
GLD	2 929,0000
HKD	9,3280
SUR	1,000
RUR	1,000
SLV	35,7200
CHF	64,1800
KZT	18,0500
USD	64,0144



3. Настройка «денежной» схемы ведения позиции

3.1 Позиции в разрезе валют

В настройках Библиотеки расчета лимитов на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» перечислите коды классов, к которым будет применяться «денежная» схема расчетов:



3.2 Мультивалютная позиция

Выполните настройку мультивалютной позиции на странице «Клиенты» на вкладке «Доп.теги расчетов» в настройке «Дополнительные валюты». В данной настройке должны быть указаны через запятую все валюты, по которым у клиентов могут возникнуть позиции. Тег расчетов (код позиции) указывается тот же, что в настройке «Теги расчетов для режимов торгов», выполненной в пп. [2.1](#) и [2.6](#).

Для классов, в которых торгуются драгоценные металлы, в качестве кодов валют используется «GLD» для золота и «SLV» для серебра.

3.3 Плановая позиция

При предоставлении доступа клиентам к инструментам с разными датами расчетов возникает необходимость ведения клиентских позиций и контроля операций по данным инструментам. Если позиция клиента не может быть объединена для разных дат исполнения, то требуется ее вести отдельно с учетом этих дат.

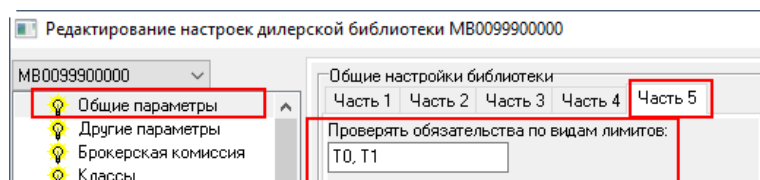
В сервере QUIK реализована возможность учета обязательств клиентов в разрезе различных дат исполнения этих обязательств. Плановая позиция на каждую дату исполнения отображается и учитывается на позициях, имеющих различный «вид лимита».

- «Вид лимита» / «Срок расчетов» – это поле в позициях клиента по деньгам и бумагам с возможными значениями T0, T1, T2, ..., Tx. Каждому виду лимита сопоставляется набор режимов торгов и/или инструментов, операции по которым рассчитываются и проверяются на этой позиции.

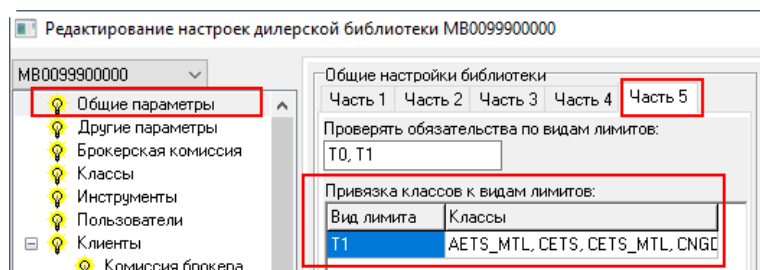
Таким образом, реализована возможность в рамках одного клиентского кода вести плановую позицию клиента на разные даты расчетов.

Для учета текущей и плановой позиции необходимо привязать тот или иной валютный инструмент к виду лимита, соответствующему дате расчетов.

Например, если торговля осуществляется только инструментами со сроками расчетов TOD («сегодня») и TOM («завтра»), то имеет смысл вести только позиции T0 и T1. В этом случае в настройке «Общие параметры / Часть 5 / Проверять обязательства по видам лимитов» укажите значение «T0, T1»:

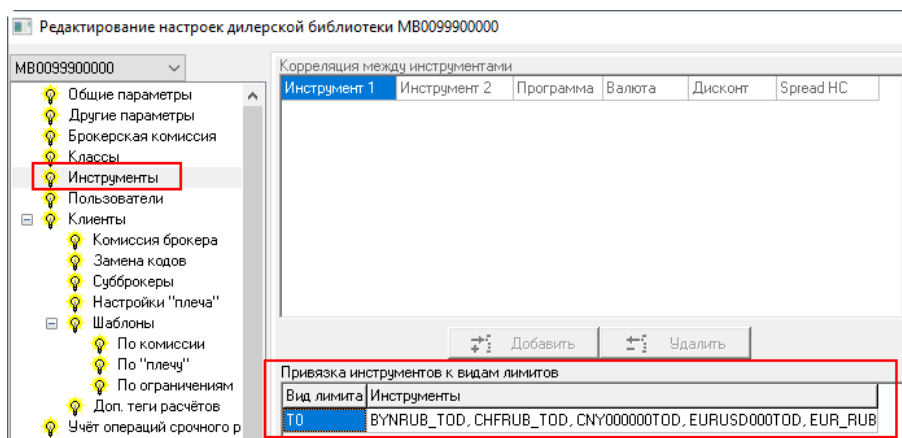


В настройке «Общие параметры / Часть 5 / Привязка классов к видам лимитов» добавьте строку со значением вида лимита «T1» и в колонке «Классы» перечислите классы валютного рынка:



В настройке «Инструменты / Привязка инструментов к видам лимитов» добавьте строку со значением вида лимита «T0» и в колонке «Инструменты» перечислите коды инструментов валютного рынка со сроком расчетов TOD через запятую:





В случае работы с инструментами со сроком расчетов более чем один обратитесь за инструкциями по настройке в Службу технической поддержки QUIK по адресу quiksupport@arqatech.com.

Таким образом, операции с расчетами «сегодня» будут учтены на позициях с видами лимитов T0 и T1, а операции текущего торгового дня с расчетами «завтра» будут учтены только на виде лимита T1.

3.4 Загрузка позиций для «денежной» схемы ведения позиции

Позиции по деньгам загружаются на тег расчетов (код позиции), указанный при настройке пп.2.1 и 2.6. Загрузка производится на все используемые для клиента виды лимитов (сроки расчетов). При этом плечо можно установить или на одну денежную позицию, или на все. При установке на все позиции размер плеча на всех позициях должен быть одинаковым.

Осуществляется загрузка одной позиции по инструменту с нулевым количеством с указанием разрешенного торгового счета и любого валютного инструмента, на который у пользователей есть права – это необходимо для привязки кода клиента к торгово-клиринговому счету (ТКС) и трансляции торгового счета пользователю с правами клиента. Позиция по инструменту загружается только на один из используемых видов лимитов (срок расчетов).

	Фирма	Срок расчетов	Валюта	Код позиции	Код клиента	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Плечо
1	MB0099900000	T0	SUR	EQTV	99901	100 000,00	100 000,00	0,00	1,00
2	MB0099900000	T1	SUR	EQTV	99901	100 000,00	100 000,00	0,00	
3	MB0099900000	T0	USD	EQTV	99901	1 000,00	1 000,00	0,00	
4	MB0099900000	T1	USD	EQTV	99901	1 000,00	1 000,00	0,00	

Пример файла для загрузки позиции:

```
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = 99901;
LIMIT_KIND = 0; OPEN_BALANCE = 100000; OPEN_LIMIT = 0; LEVERAGE = 1;
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = 99901;
LIMIT_KIND = 1; OPEN_BALANCE = 100000; OPEN_LIMIT = 0;
```



```
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = USD; CLIENT_CODE = 99901;  
LIMIT_KIND = 0; OPEN_BALANCE = 1000; OPEN_LIMIT = 0;  
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = USD; CLIENT_CODE = 99901;  
LIMIT_KIND = 1; OPEN_BALANCE = 1000; OPEN_LIMIT = 0;  
DEPO: FIRM_ID = MB0099900000; SECCODE = USD000000TOD; CLIENT_CODE = 99901; LIMIT_KIND  
= 0; OPEN_BALANCE = 0; OPEN_LIMIT = 0; TRDACCID = MB0099980001;
```

3.5 Контроль рисков в «денежной» схеме ведения позиции

Для контроля рисков может использоваться Терминальный модуль риск-менеджера CoLibri.

Доступный функционал модуля:

- Перенос отрицательных позиций на позиции T0 при использовании «денежной» схемы ведения позиции при помощи заключения сделок по SWAP-инструментам.
- Рассылка margin-call клиенту для оповещения о состоянии его портфеля.
- Закрытие позиций клиентов при соответствующем статусе портфеля клиента.

Подробнее с данным модулем можно ознакомиться по ссылке:

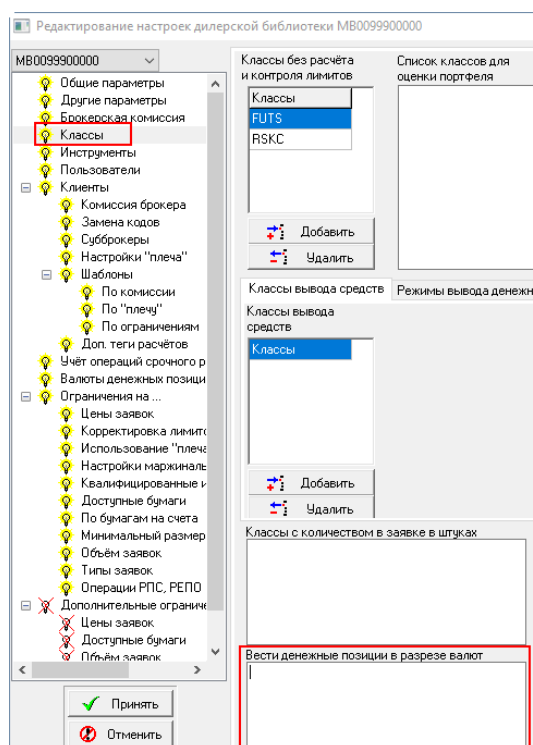
<https://arqatech.com/ru/products/quik/terminals/specialised/colibri/>



4. Настройка «инструментальной» схемы ведения позиции

4.1 Позиции в разрезе валют

В настройках Библиотеки расчета лимитов на вкладке «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» должны отсутствовать классы, к которым будет применяться «инструментальная» схема.



4.2 Загрузка позиций для «инструментальной» схемы ведения позиции

Схема загрузки позиций близка загрузке позиций на фондовом рынке.

Позиции по деньгам загружаются тег расчетов (код позиции), указанный при настройке пп. [2.1](#) и [2.6](#).

При отсутствии позиции по валютному инструменту обязательна загрузка одной нулевой позиции на любой валютный инструмент, на который у пользователей есть права – это необходимо для привязки кода клиента к торгово-клиринговому счету (ТКС) и трансляции торгового счета пользователю с правами клиента.

При наличии у клиента позиции по какому-либо валютному инструменту осуществляется загрузка позиции по соответствующему валютному инструменту с входящим количеством равным остатку по инструменту.



Для корректного расчета прибыли/убытка по портфелю клиента необходимо по открытым позициям клиентов выгружать среднюю цену приобретения данной позиции.

Нужно учесть, что на валютном рынке Московской биржи торгуются инструменты с разными датами расчетов. Если, например, клиент в текущий торговый день открыл позицию по инструменту с расчетами «завтра», то при загрузке позиции на следующий день данная позиция должна быть загружена по аналогичному инструменту, но с расчетами «сегодня».

Таблица лимитов по денежным средствам									
1	Фирма	Срок расчётов	Валюта	Код позиции	Код клиента	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Плечо
1	MB0099900000	TO	SUR	EQTV	99901	100 000,00	100 000,00	0,00	1,00

Таблица лимитов по бумагам									
1	Фирма	Код инструмента	Счет депо	Код клиента	Срок расчётов	Входящий остаток	Текущий остаток	В продаже	Цена приобретения
1	MB0099900000	USD000000TOD	MB0099800001	99901	TO	10 000	10 000	0	65,38

Пример файла для загрузки позиции:

```
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = 99901;
LIMIT_KIND = 0; OPEN_BALANCE = 1000000; OPEN_LIMIT = 0,00; LEVERAGE = 1;
DEPO: FIRM_ID = MB0099900000; SECCODE = USD000000TOD; CLIENT_CODE = 99901; LIMIT_KIND
= 0; OPEN_BALANCE = 10000; OPEN_LIMIT = 0; TRDACCID = MB0099800001; WA_POSITION_PRICE
= 65,38;
```

4.3 Торговля инструментами, не содержащими в составе рубль

Для торговли валютными парами, не содержащими в составе рубль, необходима дополнительная настройка для расчета на денежной позиции в валюте SUR для осуществления проверки покупательной способности на остатке в рублях. При выполнении настроек будет осуществляться проверка объема заявки, переведенного в рубли по кросс-курсу. Списание и зачисление объема сделки будет в рублях по величине кросс-курса сервера QUIK.

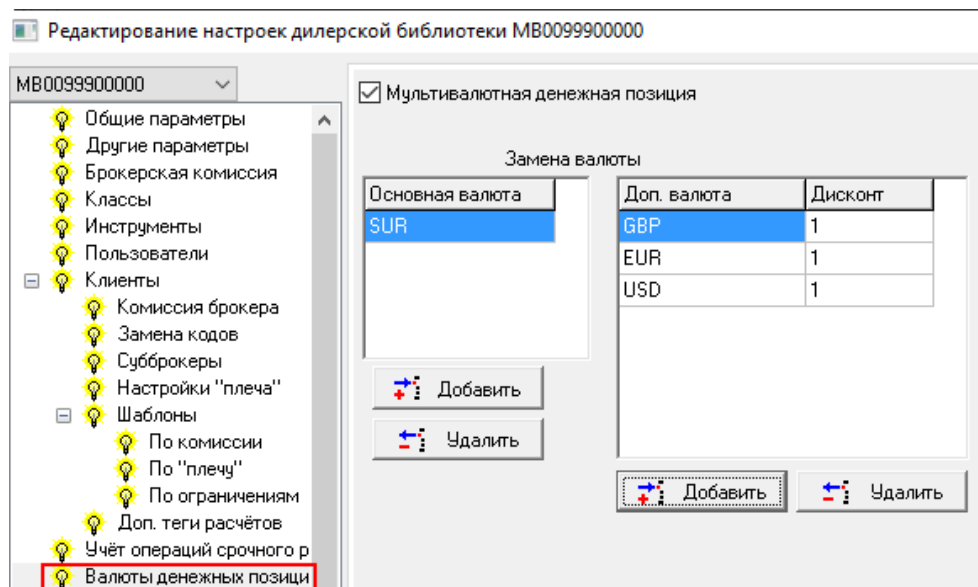
Проверьте, что в Рабочем месте для инструментов, не содержащих в составе рубль в Таблице текущих торгов значение колонки «Валюта» равно коду иностранной валюты.

Текущая таблица торгов (Валюта)	
Код инструмента	Валюта
EURUSD000TOD	EUR
GBPUSD_TOD	GBP
USDCHE_TOD	USD
USDCNY_TOD	USD
USDJPY_TOD	USD
USDKZT_TOD	USD
USDTRY_TOD	USD

Эти коды иностранных валют необходимо указать как дополнительные валюты в настройке «Валюты денежных позиций / Замена валюты», дисконт равен единице, а в качестве



основной валюты указывается SUR. Опция «Мультивалютная денежная позиция» должна быть включена.



4.4 Контроль рисков в «инструментальной» схеме ведения позиции

В случае использования «инструментальной» схемы перенос отрицательных позиций на позиции T0 при помощи модуля CoLibri не поддерживается.

Для рассылки margin-call для оповещения о состоянии портфеля можно использовать Терминальный модуль риск-менеджера CoLibri.

Закрытие позиций клиентов при соответствующем статусе портфеля клиента также может производиться с использованием Терминального модуля риск-менеджера CoLibri.

Подробнее с данным модулем можно ознакомиться по ссылке:

<https://argatech.com/ru/products/quik/terminals/specialised/colibri/>.

4.5 Ограничение на объем операций за день

Тип кредитования «Лимит на открытую позицию» позволяет настроить ограничение на дневной оборот (гросс-лимит) клиента.

Данная настройка применима только к «инструментальной» схеме ведения позиции. Поэтому настройка «Классы / Вести позиции в разрезе валют» должна быть пустой.

На странице «Настройки маржинального кредитования» укажите тип кредитования «Лимит на открытую позицию» глобально для всех клиентов (настройка «Кредитование клиентов по умолчанию») либо индивидуально для каждого кода клиента (в списке «Кредитование клиентов»).



Укажите код валюты, в которой будет установлено ограничение на объем по операциям в настройке «Валюта лимитов открытых позиций на инструменте».

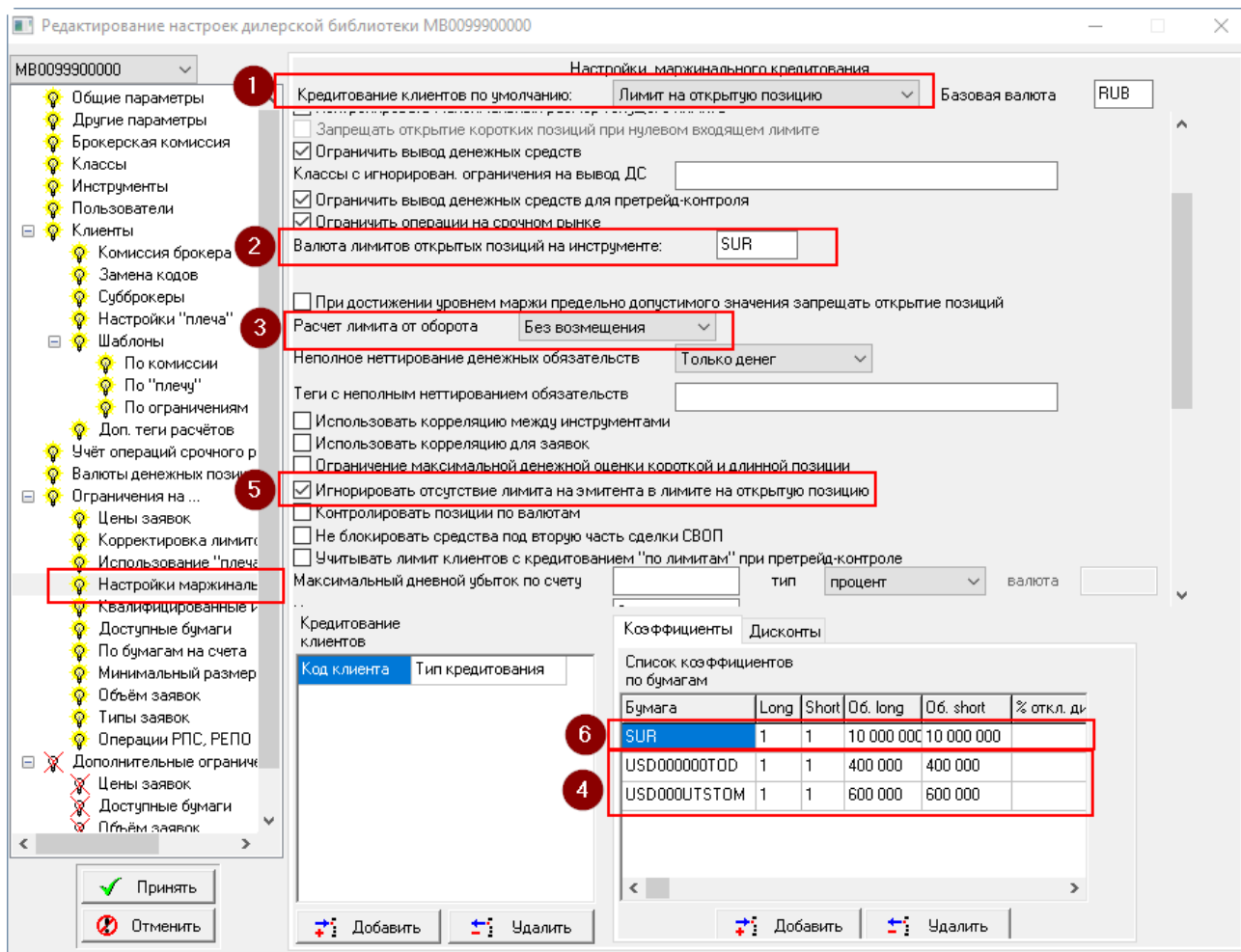
В настройке «Расчёт лимита от оборота» укажите значение «Без возмещения».

Настройте ограничение на максимальный размер оценки длинной и короткой позиции по валютным инструментам на вкладке «Коэффициенты» в колонках «Об. long» и «Об. short» соответственно. Для всех инструментов, по которым не заданы значения лимитов на короткие/длинные позиции, лимиты считаются равными нулю и открыть позицию клиентам с рассматриваемым типом лимитирования по таким инструментам будет невозможно.

Если ограничения на размер позиции по инструменту применяться не должны, то установите опцию «Игнорировать отсутствие лимита на эмитента на открытую позицию». При включении опции, если ограничение на размер оценки позиции по определенному инструменту отсутствует, то операции отвергаться не будут и ограничение на размер позиции по определенному инструменту проверяться не будет.

Настройте ограничение на суммарные оценки всех длинных и коротких позиции по валютным инструментам на вкладке «Коэффициенты» в колонках «Об. long» и «Об. short» соответственно. Настройка выполняется для бумаги равной коду валюты настроенной в п. [3](#).

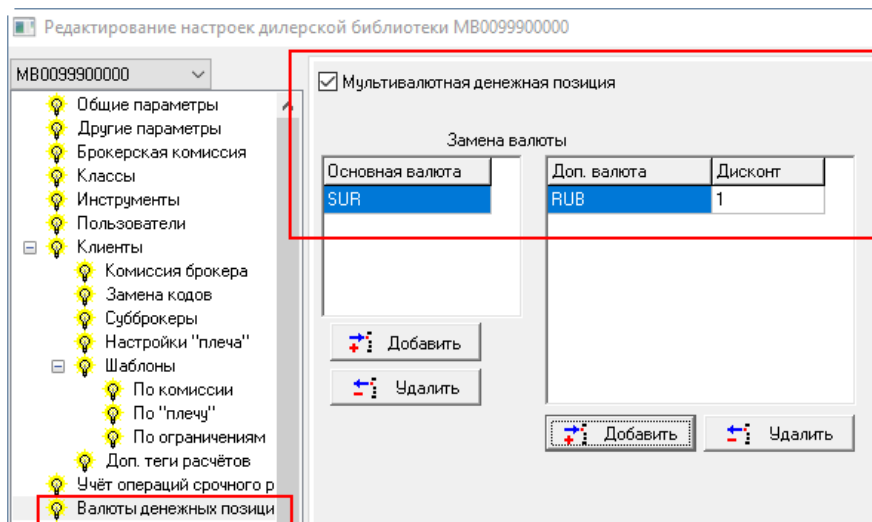
Аналогичные настройки ограничений на размер позиции в пп. [3](#) и [4](#) могут быть применены к группе клиентов. Для этого настройки делаются в маржинальном шаблоне на странице «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"».



В настройке «Валюты денежных позиций / Замена валюты» настройте связь валюты RUB и SUR. Опция «Мультивалютная денежная позиция» должна быть включена, «Основная валюта» - SUR, «Доп. валюта» - RUB и дисконт равен единице.

На сервере QUIK должны быть настроены кросс-курсы для валют с кодами SUR и RUB.





Установите в поле «Входящий лимит» сумму, которой должен быть ограничен дневной оборот клиента. Лимит задается в валюте, указанной в п.3.

Установите текущие позиции по валютным инструментам. При отсутствии позиции по валютному инструменту обязательна загрузка одной нулевой позиции на любой валютный инструмент, на который у пользователей есть права – это необходимо для привязки кода клиента к торгово-клиринговому счету (ТКС) и трансляции торгового счета пользователю с правами клиента.

Позиции по деньгам Валюта								
	Фирма	Валюта	Код позиции	Код клиента	Срок расчёта	Входящий лимит	Текущий лимит	Заблокировано
1	MB0099900000	SUR	EQTV	99901	T0	10 000 000,00	10 000 000,00	0,00

Позиции по инструментам Валюта										
	Фирма	Код инструмента	Счет деп. ▼	Код клиента	Срок расчёта	Входящий остаток	Текущий остаток	В продаже	Доступно	Цена приобретения
1	MB0099900000	USD000000TOD	MB0099950118	99901	T0	0	0	0	0	0

Пример файла для загрузки позиции:

```
MONEY: FIRM_ID = MB0099900000; TAG = EQTV; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = 99901;
LIMIT_KIND = 0; OPEN_BALANCE = 0; OPEN_LIMIT = 10000000; LEVERAGE = 1;
DEPO: FIRM_ID = MB0099900000; SECCODE = USD000000TOD; CLIENT_CODE = 99901; LIMIT_KIND
= 0; OPEN_BALANCE = 0; OPEN_LIMIT = 0; TRDACCID = MB0099800001; WA_POSITION_PRICE =
0;
```



5. Настройка схемы без контроля позиций на сервере QUIK

5.1 Настройка Программного интерфейса Клиринговой системы Валютного рынка Московской Биржи

Откройте на редактирование файл с настройками интерфейса AstsCurrRiskGate.ini и убедитесь, что в секции [General] задана настройка SendMoneyPosition=1, а настройка SendMoneyPositionOnClass отсутствует или содержит значение CETS_INFO.

Например:

```
[General]
SendMoneyPosition=1
SendMoneyPositionClass=CETS_INFO
```

5.2 Настройка прав клиента

В правах пользователя по торговым классам (например, классу CETS) достаточно настроить клиентские права, где в качестве кода клиента должен быть указан идентификатор счета (колонка «Идентификатор счета») из таблицы «Позиции участника по деньгам».

Позиции участника по деньгам										
	Фирма	Валюта	Код позиции	Идентификатор счета	Описание	Входящий	Текущий	Плановый	Контрольная	Расчетная
66	MB0099900000	UAH	UTSA	MB0099800001	Средства - UAH	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
67	MB0099900000	BYN	UTSB	MB0099800001	Средства - BYN	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
68	MB0099900000	CNY	UTSC	MB0099800001	Средства - CNY	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
69	MB0099900000	EUR	UTSE	MB0099800001	Средства - EUR	999 969 000,00	999 969 000,00	999 969 000,00	999 969 000,00	999 969 000,00
70	MB0099900000	GLD	UTSG	MB0099800001	Средства - GLD	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
71	MB0099900000	HKD	UTSH	MB0099800001	Средства - HKD	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
72	MB0099900000	KZT	UTSK	MB0099800001	Средства - KZT	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
73	MB0099900000	RUB	UTSL	MB0099800001	Единый лимит	2 586 746 099 887,26	2 586 746 099 887,26	2 586 746 099 887,26	2 586 746 099 887,26	2 586 746 099 887,26
74	MB0099900000	GBP	UTSP	MB0099800001	Средства - GBP	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
75	MB0099900000	RUB	UTSR	MB0099800001	Средства - RUB	3 128 283 852,11	3 128 283 852,11	3 128 283 852,11	3 128 283 852,11	3 128 283 852,11
76	MB0099900000	SLV	UTSS	MB0099800001	Средства - SLV	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
77	MB0099900000	USD	UTSU	MB0099800001	Средства - USD	962 140 334,25	962 140 334,25	962 140 334,25	962 140 334,25	962 140 334,25
78	MB0099900000	UAH	UTSA	MB0099800002	Средства - UAH	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00
79	MB0099900000	BYN	UTSB	MB0099800002	Средства - BYN	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00	1 000 000 000,00



Общие права Безопасность Права по классам Операции

☒ Классы
 ☐ Рынки
 ☐ С правами
 ☒ Все

Код класса	Наименование класса	Рынок	Роль	Код фирмы	Код у дилера	Кол-во
CETS	МБ Валюта: ETC	МБ Валютный	Клиент	MB0099900000		1

Шаблон прав:

Код фирмы: MB0099900000

☒ Класс доступен
 ☒ Расширенные параметры
 ☒ Котировки
 ☐ Обезличенные сделки
 ☒ Клиент фирмы
 ☒ Заявки
 ☒ Сделки
 ☐ Стоп-заявки
 ☐ Перенос стоп-заявок
 ☐ Работа со справочником инструментов
 ☐ Дополнительная информация по котировкам
 ☐ Двусторонние котировки
 ☐ Отображение наименования класса

☒ Активные операции
 ☐ Работа с подтверждениями
 ☒ Рыночные заявки на покупку
 ☐ Заявки "До отмены"
 ☐ Игнорировать примечание
 ☐ Подпись файлов не обязательна
 ☐ Специальные операции
 ☐ Субадминистратор
 Код у дилера
 ☐ Установка лимитов только по деньгам
 ☐ Торговый субадминистратор
 ☐ Только изменение плеча
 ☐ Запрос цены у дилера

☐ Установка лимитов
 ☐ Только просмотр лимитов
 ☐ Денежные позиции брокера
 ☐ Позиции брокера по бумагам
 ☐ Просмотр заявок, сделок по фирме брокера
 ☐ Просмотр по всем брокерам
 ☐ Показывать клиентские ошибки
 ☐ Подтверждение заявок клиентов
 ☐ Игнорировать отсутствие лимитов
 ☐ Установка кросс-курсов для OMS
 ☐ Процентная ставка по операциям SWAP

Коды клиентов у дилера (через ,)

☐ Инверсия списка: перечисленные коды запрещены

Кодов в списке: 1

По классу CETS_INFO дополнительно должна быть включена опция «Денежные позиции брокера». Обязательно должны быть установлены опции «Заявки» и «Сделки».

Общие права Безопасность Права по классам Операции

☒ Классы
 ☐ Рынки
 ☐ С правами
 ☒ Все

Код класса	Наименование класса	Рынок	Роль	Код фирмы	Код у дилера	Кол-во
CETS_INFO	МБ Валюта: ETC (Информационный МБ Валютный	МБ Валютный	Клиент	MB0099900000		1

Шаблон прав:

Код фирмы: MB0099900000

☒ Класс доступен
 ☒ Расширенные параметры
 ☒ Котировки
 ☐ Обезличенные сделки
 ☒ Клиент фирмы
 ☒ Заявки
 ☒ Сделки
 ☐ Стоп-заявки
 ☐ Перенос стоп-заявок
 ☐ Работа со справочником инструментов
 ☐ Дополнительная информация по котировкам
 ☐ Двусторонние котировки
 ☐ Отображение наименования класса

☒ Активные операции
 ☐ Работа с подтверждениями
 ☒ Рыночные заявки на покупку
 ☐ Заявки "До отмены"
 ☐ Игнорировать примечание
 ☐ Подпись файлов не обязательна
 ☐ Специальные операции
 ☐ Субадминистратор
 Код у дилера
 ☐ Установка лимитов только по деньгам
 ☐ Торговый субадминистратор
 ☐ Только изменение плеча
 ☐ Запрос цены у дилера

☐ Установка лимитов
 ☐ Только просмотр лимитов
 ☒ Денежные позиции брокера
 ☐ Позиции брокера по бумагам
 ☐ Просмотр заявок, сделок по фирме брокера
 ☐ Просмотр по всем брокерам
 ☐ Показывать клиентские ошибки
 ☐ Подтверждение заявок клиентов
 ☐ Игнорировать отсутствие лимитов
 ☐ Установка кросс-курсов для OMS
 ☐ Процентная ставка по операциям SWAP

Коды клиентов у дилера (через ,)

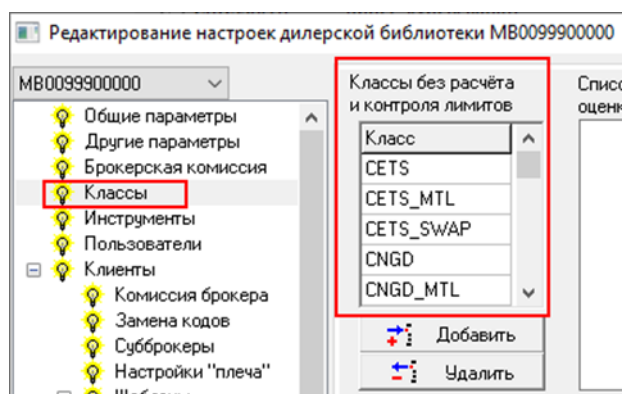
☐ Инверсия списка: перечисленные коды запрещены

Кодов в списке: 1



5.3 Настройка Библиотеки расчета лимитов

Добавьте в настройку «Классы / Классы без расчёта и контроля лимитов» все классы, по которым контроль операций будет проводиться только на стороне биржи.



5.4 Загрузка позиций в схеме без контроля позиций на сервере QUIK

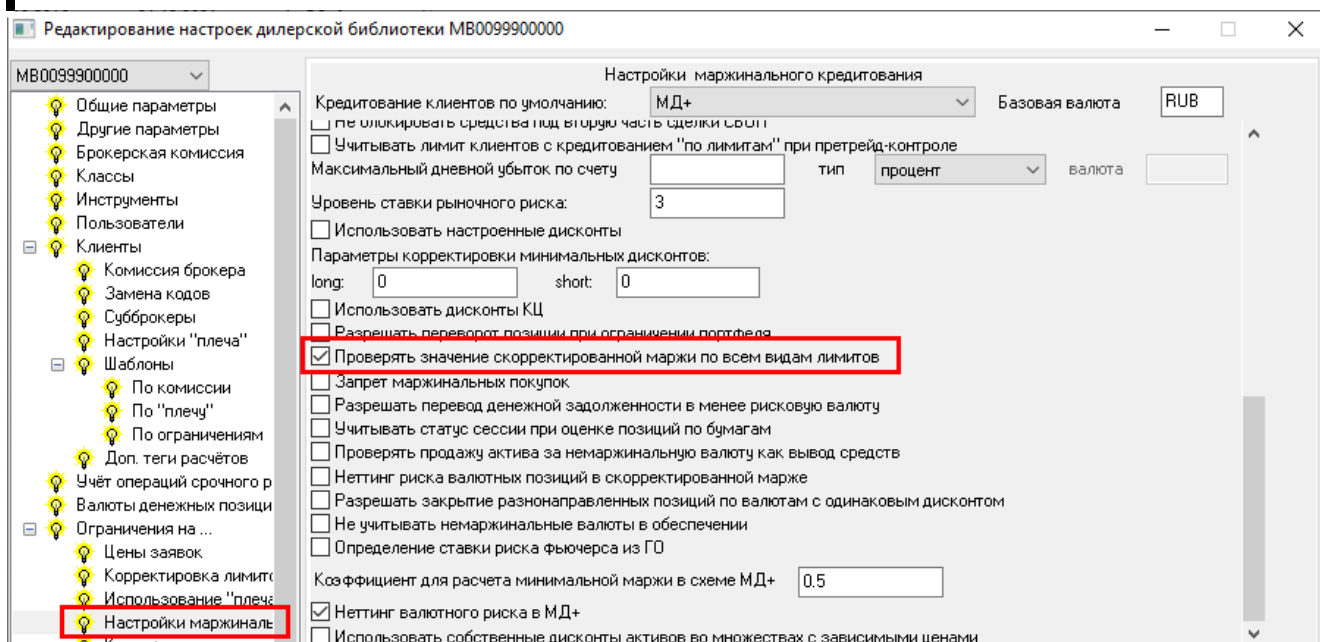
Осуществляется загрузка одной позиции по инструменту с нулевым количеством с указанием разрешенного торгового счета и любого валютного инструмента, на который у пользователей есть права – это необходимо для привязки кода клиента к торгово-клиринговому счету (ТКС) и трансляции торгового счета пользователю с правами клиента. В качестве кода клиента указывается идентификатор счета из таблицы «Позиции участника по деньгам», который указан в качестве кода клиента в правах пользователя.

Позиции по деньгам не загружаются.

Позиции по инструментам								
	Фирма	Код клиента	Срок расчётов	Код инструмента	Счет депо	Входящий остаток	Текущий остаток	В продаже
1	MB0099900000	MB0099800001	Т0	USD000000TOD	MB0099800001	0	0	0

6. Настройка маржинального кредитования

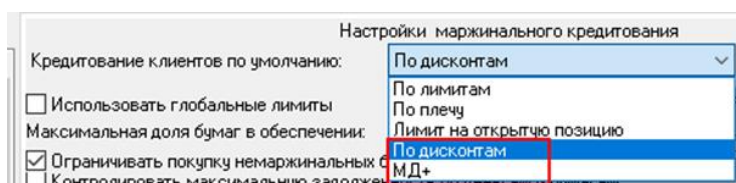
!!!ВАЖНО!!! Для «денежной» схемы ведения позиции на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования» включите опцию «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов». Удостоверьтесь, что инструменты с разными датами расчетов учитываются на разных видах лимитов. Такая настройка защитит от открытия недопустимо большой позиции по валюте со сроком расчетов в Т0 путем заключения последовательных сделок разной направленности с инструментами с разными сроками расчетов, например, ТОД и ТОМ.



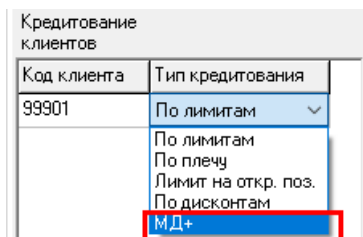
Наиболее распространенный подход к использованию маржинального кредитования на валютном рынке – это настройка схемы кредитования «МД+». В рамках данной схемы на любой из кодов валют может быть настроен дисконт, в результате чего можно будет совершать операции с неполным преддепонированием.

Выбор типа кредитования «МД+» выполняется на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования».

Для использования данной схемы маржинального кредитования для всех клиентов выберите ее в настройке «Кредитование клиентов по умолчанию»:



Если данную схему маржинального кредитования необходимо использовать только для определенных клиентов, добавьте их в список «Кредитование клиентов» и в выпадающем списке выберите необходимый тип:



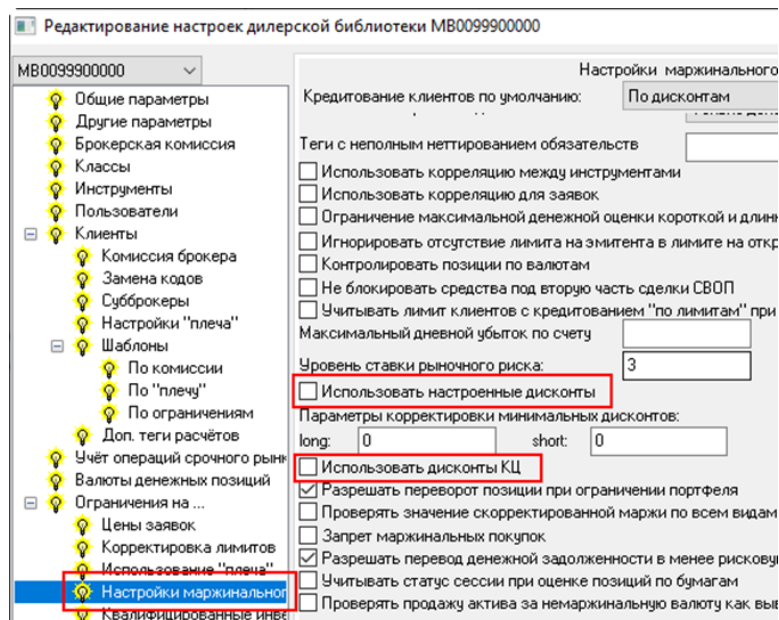
Для маржинальных клиентов необходимо настроить дисконты, определяющие количество доступных заемных средств клиента.

Существует два варианта использования дисконтов:

- Использование собственных явно заданных в настройках дисконтов.
- Использование дисконтов КЦ.

Настройки дисконтов выполняются не глобально, а в шаблонах «по плечу» для маржинальных клиентов.

Перед настройкой дисконтов убедитесь, что на странице «Ограничения на .../ Настройки маржинального кредитования» опции «Использовать настроенные дисконты» и «Использовать дисконты КЦ» **отключены**.



Для «денежной» схемы ведения позиции настройка дисконтов осуществляется как на код валюты, так и на коды валютных инструментов.
Для «инструментальной» схемы ведения позиции настройка дисконтов осуществляется только на коды валютных инструментов.



6.1 Использование явно заданных в настройках дисконтов

На странице «Клиенты / Шаблоны / По «плечу»» на вкладке «Диск. по бум.» в параметрах D_{long} и D_{short} укажите значения дисконтов для оценки длинной и короткой позиции в том размере, в котором он должен примениться к соответствующей позиции. Параметры $D_{minlong}$, $D_{minshort}$, K_{long} и K_{short} должны быть пустые

Пример настройки для «денежной» схемы:

Кэф. по бум.	Диск. по бум.	Теги для реж. торг.	Тег			
Список дисконтов по бумагам						
Бумага	D long	D short	D m	D n	K ld	K shor
USD	0.5	0.5				
USD000000TOD	0.5	0.5				
USD0000TSTOM	0.5	0.5				

Пример настройки для «инструментальной» схемы:

Кэф. по бум.

Диск. по бум.

Теги для реж. торг.

Теги

Список дисконтов по бумагам

Бумага	D long	D short	D m	D n	K lq	K short
USD000000TOD	0.5	0.5				
USD0000TSTOM	0.5	0.5				

6.2 Использование дисконтов КЦ

Данная схема применима только к «денежной» схеме ведения позиции.

Настройки при использовании дисконтов КЦ для валют аналогичны фондовому рынку.

На странице «Клиенты / Шаблоны / По «плечу»» на вкладке «Диск. по бум.» для валют указываются параметры $D_{long}=D_{short}=0$, для клиентов со стандартным уровнем риска $K_{long}=K_{short}=2$, с повышенным уровнем риска $K_{long}=K_{short}=1$.

При такой настройке эффективные дисконты для валюты будет рассчитываться по формулам:

$$D_{long} = 1 - (1 - \text{Max}(KЦ; D_{long}))^{K_{long}}$$

$$D_{short} = (1 + \text{Max}(KЦ; D_{short}))^{K_{short}} - 1$$

Дисконты на валюты будут использоваться для осуществления проверки покупательной способности и расчета портфеля клиента.

Но в таблице «Купить/Продать» отображаются строки не по валютам, а по валютным инструментам и для корректного отображения в данной таблице необходимо дополнительно настроить дисконты на валютные инструменты.

Поэтому важно дополнительно задать вручную информационные дисконты на коды инструментов валютных пар - USD000000TOD, USD000UTSTOM и прочие в размере эффективных дисконтов валюты. В данном случае информационные дисконты настраиваются без коэффициентов Klong и Kshort, данные колонки остаются пустыми. Такая настройка явно заданными дисконтами необходима, так как дисконты КЦ транслируются только в разрезе кода валюты, но не валютных пар.

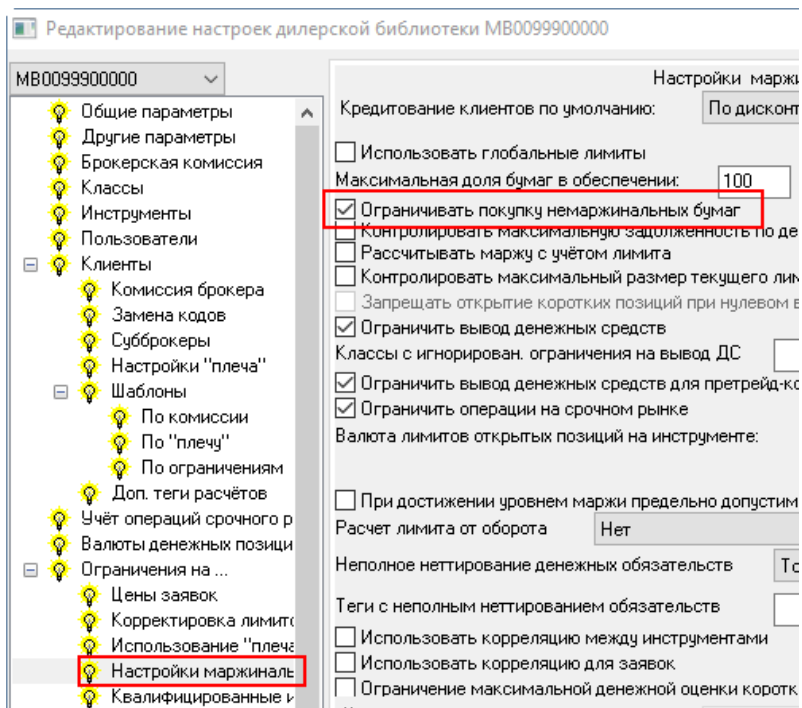
Например:

Козф. по бум.	Диск. по бум.	Теги для реж. торг.	Тег	
Список дисконтов по бумагам				
Бумага	Д long	Д short	К long	К short
EUR	0	0	1	1
EUR_RUB__TOD	0.06	0.06		
EUR_RUB__TOM	0.06	0.06		
USD	0	0	1	1
USD000000TOD	0.06	0.06		
USD000UTSTOM	0.06	0.06		

6.3 Дополнительные опции

Ограничивать покупку немаржинальных бумаг

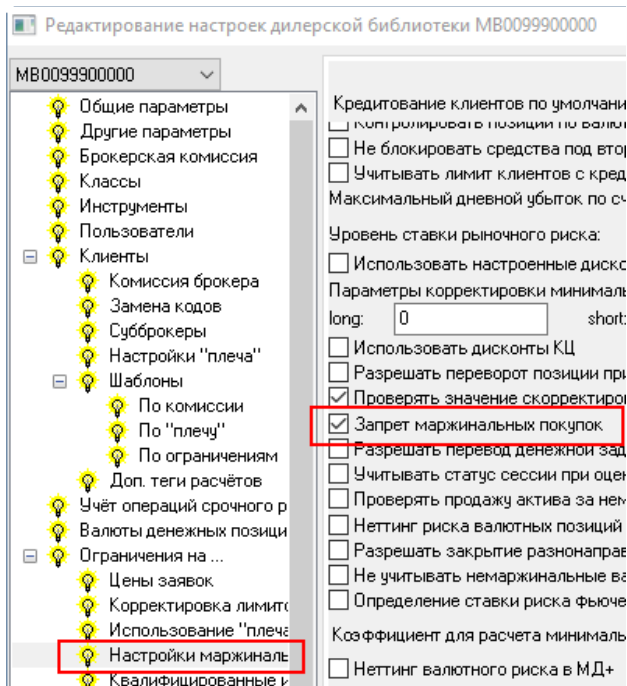
По умолчанию при наличии маржинальной позиции сумма средств, доступная для покупки немаржинальных валют, определяется как разность стоимости портфеля клиента и скорректированной маржи. При этом свободный остаток по деньгам клиента не учитывается, и клиент может совершить операцию с немаржинальной валютой, которая приведет к минусу по рублям или по другой маржинальной валюте. Данное поведение можно изменить, включив настройку «Ограничивать покупку немаржинальных бумаг» на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования». При ее включении сумма для покупки немаржинальной валюты будет ограничена суммой свободного текущего остатка в валюте списания.



Открытие позиции по определенной валюте только за собственные средства

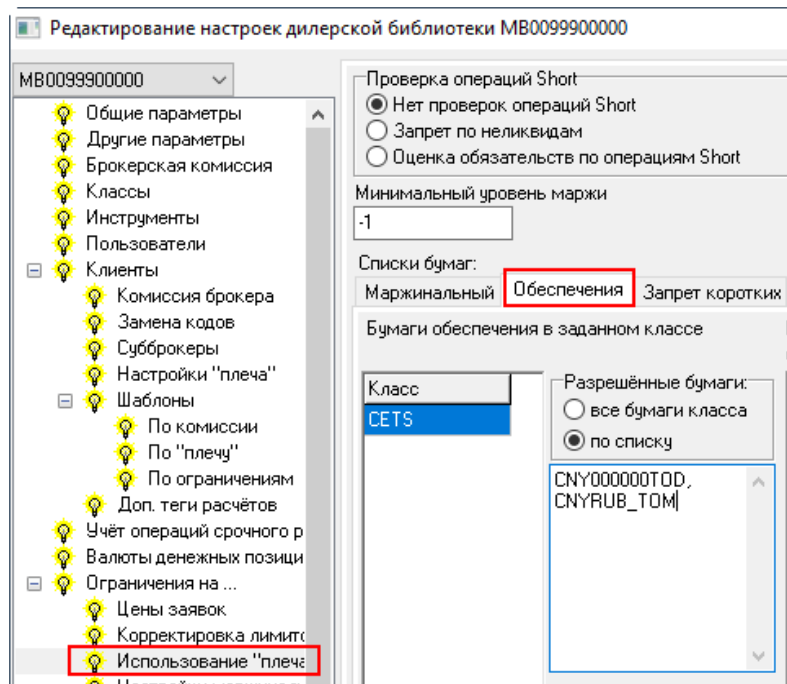
Допустим, что у клиента есть позиция по маржинальной валюте и данная позиция должна учитываться при расчете маржинальных показателей, но при этом нельзя совершать операции с инструментами, содержащими данную валюту на сумму больше свободного остатка в этой валюте.

Такое поведение можно настроить на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования» включив настройку «Запрет маржинальных покупок».



Затем добавьте коды валютных инструментов, торговля которыми должна осуществляться в рамках остатка, на странице «Ограничения на ... / Использование "плеча"» на вкладку «Обеспечения».

Чтобы настройка «Запрет маржинальных покупок» работала корректно на код инструмента валютной пары (например, CNY000000TOD, CNURUB_TOM), должны быть настроены дисконты, делающие данный инструмент маржинальным и равные дисконтам по соответствующей валюте.

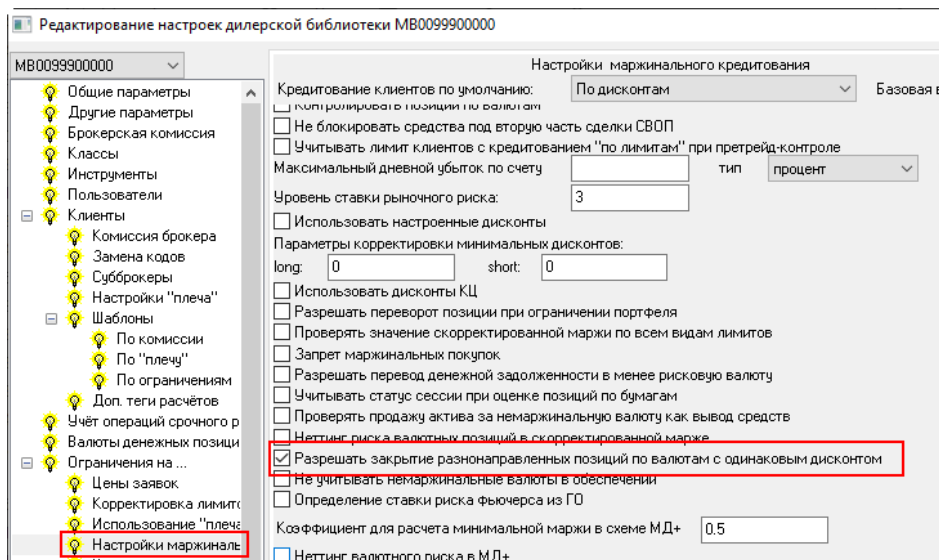


Разрешать закрытие разнонаправленных позиций по валютам с одинаковым дисконтом

Включение настройки разрешает закрытие разнонаправленных позиций с равными дисконтами валют для конверсионных операций в схеме «МД+» при настроенной «денежной» схеме ведения позиции, если не происходит переворота позиции ни по одной из валют пары. Это дает возможность закрывать позицию по одной валюте за счет другой, например, закрыть отрицательную позицию USD с использованием положительного остатка EUR без использования рублей.

Настройка выполняется на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования»:

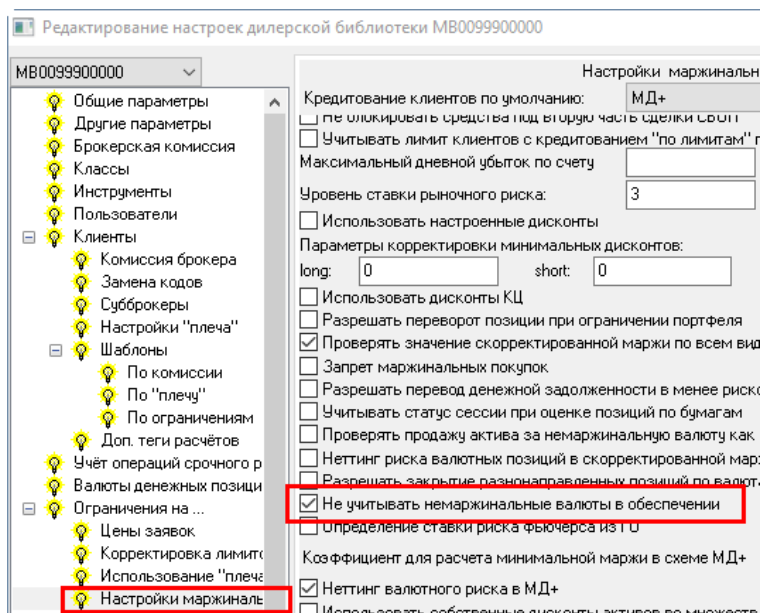




Если, согласно настройкам системы, подразумевается списание комиссии с какой-либо третьей валюты, то проверка достаточности средств под эту комиссию не осуществляется.

Не учитывать немаржинальные валюты в обеспечении

Настройка выполняется на странице «Ограничения на ... / Настройки маржинального кредитования»:



При включенной настройке при расчете маржинальных показателей позиции по немаржинальным валютам не учитываются.

При этом операции продажи маржинального актива за немаржинальную валюту не считаются закрытием позиции (так как аналогичны выводу средств) и проверяются по маржинальным требованиям.



Настройка поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Для клиентов с типом кредитования «МД+» немаржинальные валюты не учитываются при расчете маржинальных показателей не зависимо от состояния данной настройки.



7. Дополнительные режимы торгов

7.1 Работа со сделками по средневзвешенному курсу

Общие сведения

Московская Биржа 4 марта 2019 года запустила режимы торгов для заключения сделок по средневзвешенному курсу.

Заключение сделок производится в классах:

Код	Наименование
WAPN	МБ Валюта: Внесистемные средневзвешенные
WAPS	МБ Валюта: Системные средневзвешенные

В классах с кодами WAPS и WAPN используется валютная пара USDRUB_WAP0 для торгов с использованием средневзвешенного курса USDRUB_TOM по состоянию на 11:30 (курс ЦБ).

Техническая реализация этого режима торгов аналогична торгам по цене фиксинга.

Принимаются только лимитированные заявки с нулевой ценой в период с 9:45 до 10:00 дня расчета средневзвешенного курса. Во внесистемном классе WAPN необходимо указать код расчетов FIX0.

Форма подачи заявки в системном классе:

МБ Валюта: Системные средневзвешенные Ввод заявки

Инструмент: USD RUB WAP0

Торговый Счет: MB0099800001

Ввод цены:

☒ Покупка ☐ Продажа

Цена: 0

Кол-во (лот 100000): 1

☐ Рыночная

Код Клиента: 99801/101

Поручение:

Объем и комиссия: 0,00

Задать количество

Условие исполнения: Поставить в очередь

Да Отмена <<

Форма подачи заявки во внесистемном классе:



МБ Валюта: Внесистемные средневзвешенные Ввод ад...

Инструмент: USDRUBWAP0 Торговый Счет: MB0099800099

Операция: ☒ Покупка ☐ Продажа

Код расчетов: FIX0 Дата расчетов: 22.02.2019

Цена: 0 Количество: 1 Лот: 100000

Партнер: НКО НКЦ(АО) [NCC000100000]

Код Клиента: 99801/101 Поручение:

Возмещение: Ссылка: Валюта расчетов:

Ввести Отмена

Для класса системных сделок зарегистрированные заявки отображаются в Таблице заявок:

Номер	Код класса	Код инструмента	Операция	Счет	Цена	Кол-во	Объем	Комментарий	Состояние
1 644 343 814	WAPS	USDRUB_WAP0	Купля	MB0099800099	0,0000	1	0,00	99801/101/	Исполнена
2 644 347 632	WAPS	USDRUB_WAP0	Продажа	MB0099800099	0,0000	2	0,00	99801/101/	Исполнена

Для класса внесистемных сделок зарегистрированные заявки отображаются в Таблице заявок на внебиржевые сделки:

Номер	Код инструмента	Код класса	Операция	Цена	Кол-во	Код расчетов	Объем	Счет	Комментарий
1 644 355 128	USDRUB_WAP0	WAPN	Купля	0,0000	2	FIX0	0,00	MB0099800099	99801/101/
2 644 355 664	USDRUB_WAP0	WAPN	Продажа	0,0000	1	FIX0	0,00	MB0099800099	99801/101/

На основе сделок по USDRUB_WAP0 после расчета средневзвешенного курса в 11:30 в торговой системе формируются технические внебиржевые заявки и сделки по инструменту USDRUB_TOM в соответствующих классах WAPS/WAPN.

Номер	Код инструмента	Код класса	Операция	Цена	Кол-во	Код расчетов	Объем	Счет	Комментарий
1 644 344 802	USD000UTSTOM	WAPS	Купля	59,7653	100	N1	5 976 530,00	MB0099800099	99801/101/
2 644 347 972	USD000UTSTOM	WAPS	Продажа	59,7653	200	N1	11 953 060,00	MB0099800099	99801/101/
3 644 357 296	USD000UTSTOM	WAPN	Купля	59,7653	200	N1	11 953 060,00	MB0099800099	99801/101/
4 644 357 852	USD000UTSTOM	WAPN	Продажа	59,7653	100	N1	5 976 530,00	MB0099800099	99801/101/

В Таблице сделок для сделок с инструментом USDRUB_TOM в поле «Заявка» указывается номер исходной заявки по WAP-инструменту, а в поле «Исходный номер» – номер сделки по инструменту USDRUB_WAP0.



Таблица сделок											
	Номер	Исходный номер	Заявка	Код класса	Код инструмента	Операция	Цена	Кол-во	Объем	Счет	Комментарий
1	157 473 033		644 343 814	WAPS	USDRUB_WAP0	Купля	0,0000	1	0,00	MB0099800099	99801/101/
2	157 473 035	157 473 033	644 343 814	WAPS	USD000UTSTOM	Купля	59,7653	100	5 976 530,00	MB0099800099	99801/101/
3	157 473 056		644 347 632	WAPS	USDRUB_WAP0	Продажа	0,0000	2	0,00	MB0099800099	99801/101/
4	157 473 060	157 473 056	644 347 632	WAPS	USD000UTSTOM	Продажа	59,7653	200	11 953 060,00	MB0099800099	99801/101/
5	157 473 174		644 355 128	WAPN	USDRUB_WAP0	Купля	0,0000	2	0,00	MB0099800099	99801/101/
6	157 473 176	157 473 174	644 355 128	WAPN	USD000UTSTOM	Купля	59,7653	200	11 953 060,00	MB0099800099	99801/101/
7	157 473 198		644 355 664	WAPN	USDRUB_WAP0	Продажа	0,0000	1	0,00	MB0099800099	99801/101/
8	157 473 202	157 473 198	644 355 664	WAPN	USD000UTSTOM	Продажа	59,7653	100	5 976 530,00	MB0099800099	99801/101/

Для осуществления контроля покупательной способности в данных классах и расчета операций на позиции клиентов необходимо выполнить ряд настроек Библиотеки расчета лимитов.

Настройка Библиотеки расчета лимитов

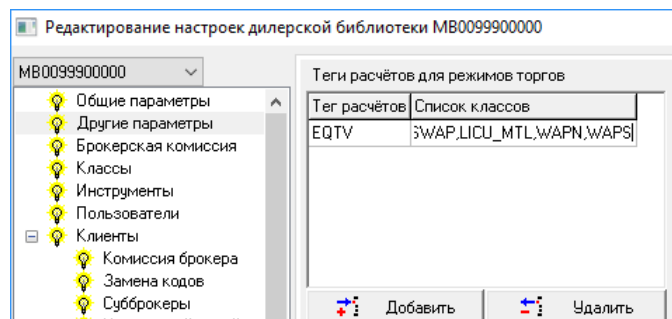
Настройка Библиотеки расчета лимитов выполняется для фирмы валютного рынка Московской биржи.

Классы без расчета и контроля лимитов

Если операции в данном режиме нужно проверять и рассчитывать на позициях клиентов, то удалите значения WAPN, WAPS из настройки «Классы без расчёта и контроля лимитов» на странице «Классы».

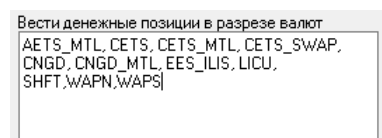
Теги расчетов для режимов торгов

На странице «Другие параметры» в списке «Теги расчётов для режимов торгов» добавьте привязку классов WAPN, WAPS к тегу расчетов (коду позиции), который используется для основных режимов торгов валютного рынка.



Денежные позиции в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку классы WAPN, WAPS.



Настройка валюты комиссии

Если на странице «Брокерская комиссия» заданы настройки «Валюта расчёта комиссии» и «Валюта списания комиссии» для основных режимов торгов валютного рынка, то добавьте в данные настройки классы WAPN, WAPS.

Валюта расчёта комиссии	
Валюта	Список классов
SUR	, SHFT, WAPN, WAPS

Валюта списания комиссии	
☐ Запр. опер. при нехв. сред. под ком.	
☐ Разр. зак. поз. при нехв. ср. под ком.	
Валюта	Список классов
SUR	, SHFT, WAPN, WAPS

Настройка связи между инструментами валютного рынка и инструментами заключения сделок по средневзвешенному курсу

Перейдите на страницу «Инструменты».

В список «Взаимозаменяемые инструменты» добавьте следующие инструменты заключения сделок по средневзвешенному курсу:

Основной	Аналог
USD000UTSTOM	USDRUB_WAP0

Порядок настройки списка «Взаимозаменяемые инструменты» описан в Руководстве по администрированию Библиотеки расчета лимитов.

Если заданы индивидуальные настройки для инструментов, которые являются основными для инструментов заключения сделок по средневзвешенному курсу, то необходимо продублировать инструменты заключения сделок по средневзвешенному курсу в этих же настройках наряду с основными инструментами. Список настроек:

- Страница «Инструменты», поле «Привязка инструментов к видам лимитов»;
- Страница «Инструменты», поле «Корреляция между инструментами»;
- Страница «Доп. теги расчётов», вкладка «Теги, определяемые по коду инструмента»;
- Страница «Ограничения на / Использование "плеча"», поля «Списки бумаг»;
- Страница «Ограничения на / Настройки маржинального кредитования», вкладка «Коэффициенты»;
- Страница «Ограничения на / Настройки маржинального кредитования», вкладка «Дисконты»;
- Страница «Шаблоны» / По "плечу", вкладка «Теги, опр. по коду INSTR.»;
- Страница «Шаблоны» / По "плечу", вкладка «Корреляция между инструментами»;
- Страница «Шаблоны» / По "плечу", вкладка «Прив. INSTR. к видам лимитов»;
- Страница «Шаблоны» / По "плечу", кнопка «Списки маржинальных бумаг».

Прочие настройки

Корректный расчет позиций осуществляется только для клиентов с выбранным типом кредитования «по плечу», «по дисконтам» и «МД+».

На странице «Общие параметры», вкладка «Часть 3», флажок «Рассчитывать позиции в лотах» должен быть выключен.

7.2 Работа с классами урегулирования

Общие сведения

Московская Биржа 4 марта 2019 года запустила новый режим торгов урегулирования на валютном рынке, в котором могут подаваться только безадресные заявки "всем", как обычные, так и своп.

В связи с этим в системе QUIK поддерживаются классы:

Код	Наименование
LICU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования
LICU_SWAP	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (SWAP)
LICU_MTL	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (Металлы)

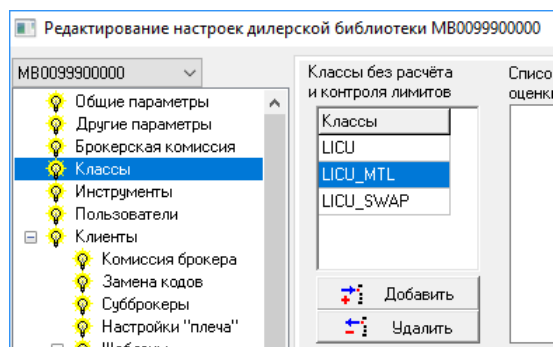
Для корректного расчета покупательной способности при работе с новыми классами необходимо выполнить ряд настроек Библиотеки расчета лимитов.

Настройка Библиотеки расчета лимитов

Настройка Библиотеки расчета лимитов выполняется для фирмы валютного рынка Московской биржи.

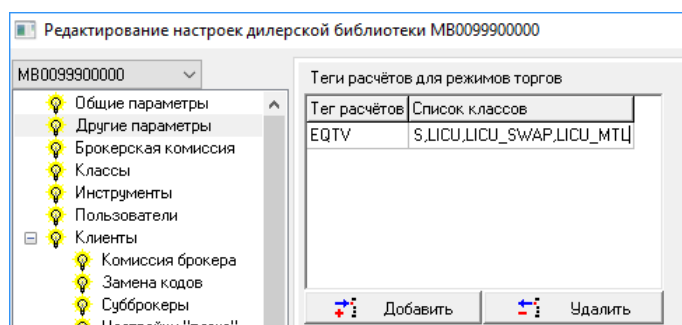
Теги расчетов для режимов торгов

Если операции в данном режиме не нужно проверять и рассчитывать на позициях клиентов, добавьте классы LICU, LICU_SWAP, LICU_MTL в настройку «Классы / Классы без расчёта и контроля лимитов». Дальнейшие пункты инструкции можно пропустить.



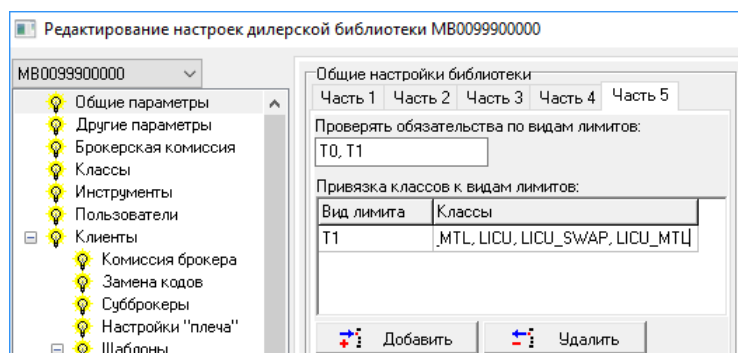
Если же контроль и расчет операций необходим, то на странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» добавьте привязку классов LICU, LICU_SWAP,

LICU_MTL к тегу расчетов (коду позиции), который используется для основных режимов торгов валютного рынка.



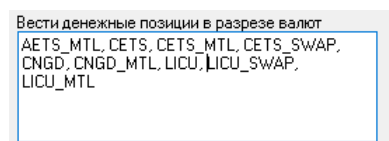
Привязка классов и кодов расчета к видам лимита

Если контроль операций клиентов осуществляется при помощи функционала «Вид лимита», перейдите на страницу «Общие настройки» на вкладку «Часть 5» и привяжите классы LICU, LICU_SWAP, LICU_MTL к виду лимита, который используется для основных режимов торгов валютного рынка.



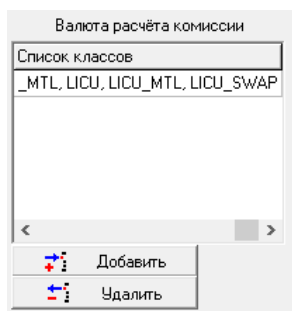
Настройка ведения позиций в разрезе валют

Откройте раздел «Классы» и если в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, то также добавьте в данную настройку классы LICU, LICU_SWAP, LICU_MTL.



Настройка валюты комиссии

Откройте раздел «Брокерская комиссия» и если у Вас выполнены настройки «Валюта расчёта комиссии» и «Валюта списания комиссии» для основных режимов торгов валютного рынка, то добавьте классы LICU, LICU_SWAP, LICU_MTL в данные настройки.



7.3 Работа в режиме торгов фиксинга

Общие сведения

Для корректного расчета покупательной способности при работе с классами торгов фиксинга необходимо выполнить ряд настроек сервера QUIK и Библиотеки расчета лимитов.

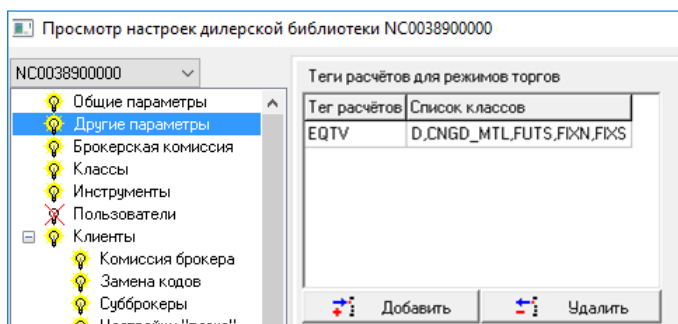
Перечень классов торгов фиксинга:

Код	Наименование
FIXS	МБ Валюта: Фиксинг
FIXN	МБ Валюта: РПС Фиксинг

Настройка Библиотеки расчета лимитов

Теги расчетов для режимов торгов

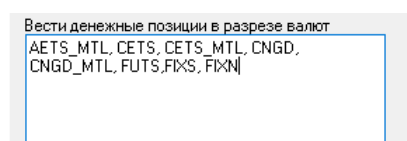
На странице «Другие параметры» в списке «Теги расчётов для режимов торгов» добавьте для используемого тега расчетов (кода позиции) классы FIXS, FIXN.



Денежные позиции в разрезе валют

В связи с добавлением нового класса валютного рынка необходимо настроить использование новых режимов торгов в «денежной» или «инструментальной» схеме ведения позиции.

Проверьте следующую настройку «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы»:



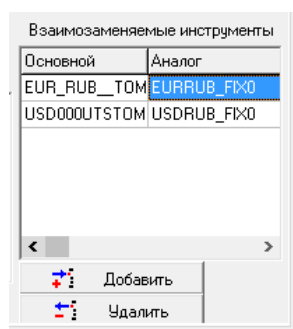
Если поле пустое, значит, используется «инструментальная» схема и этот пункт можно пропустить. Если список классов заполнен, то добавьте классы FIXS, FIXN в список.

Аналогичным образом необходимо проверить наличие индивидуальных настроек привязки режимов торгов к виду лимитов на следующих страницах:

- «Клиенты / Комиссия брокера», вкладка «Специальные классы / Позич. в разр. валют».
- «Шаблоны / По комиссии», вкладка «Специальные классы/ Позич. в разр. валют».

Настройка связи между инструментами валютного рынка и инструментами фиксинга

Перейдите на страницу «Инструменты».



В список «Взаимозаменяемые инструменты» добавьте следующие инструменты фиксинга:

Основной	Аналог
USD000UTSTOM	USDRUB_FIX0
EUR_RUB__TOM	EURRUB_FIX0

Порядок настройки списка «Взаимозаменяемые инструменты» описан в Руководстве по администрированию Библиотеки расчета лимитов.

Если сделаны индивидуальные настройки для инструментов, которые являются основными для инструментов фиксинга, такие как:

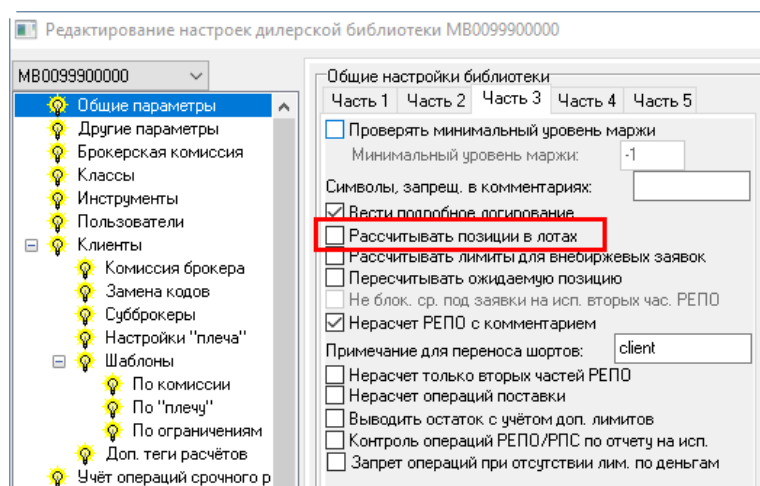
- Страница «Инструменты», поле «Привязка инструментов к видам лимитов».
- Страница «Инструменты», поле «Корреляция между инструментами».
- Страница «Доп. теги расчётов», вкладка «Теги, определяемые по коду инструмента».
- Страница «Ограничения на / Использование "плеча"», поля «Списки бумаг».
- Страница «Ограничения на / Настройки маржинального кредитования», вкладка «Коэффициенты».
- Страница «Ограничения на / Настройки маржинального кредитования», вкладка «Дисконты».
- Страница «Шаблоны» / По "плечу", вкладка «Теги, опр. по коду INSTR.».

- Страница «Шаблоны» / По «плечу», вкладка «Корреляция между инструментами».
- Страница «Шаблоны» / По «плечу», вкладка «Прив. INSTR. к видам лимитов».
- Страница «Шаблоны» / По «плечу», кнопка «Списки маржинальных бумаг».

то необходимо продублировать инструменты фиксинга в этих же настройках наряду с основными инструментами.

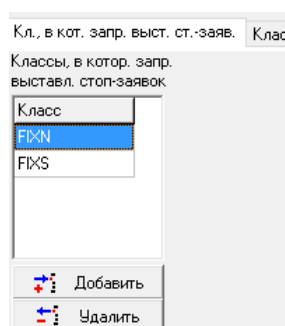
Прочие настройки

- Корректный расчет позиций осуществляется только для клиентов с выбранным типом кредитования «по плечу», «по дисконтам», «МД+».
- Признак на странице «Общие параметры», вкладка «Часть 3», флажок «Рассчитывать позиции в лотах» должен быть выключен.



Запрет выставления стоп-заявок

В новом режиме торгов отсутствует Таблица обезличенных сделок, поэтому необходимо пользователям запретить выставлять стоп-заявки по классам FIXS, FIXN в настройке «Классы, в которых запрещено выставление стоп-заявок».



7.4 Работа с классами крупных сделок

Общие сведения

Московская Биржа 25 ноября 2019 года запустила новый режим торгов крупными сделками на валютном рынке. Режим предназначен для заключения крупных безадресных сделок по



спот инструментам с использованием технологии speed bump. Более подробная информация о данном режиме доступна по ссылке: www.moex.com/n25746.

В системе QUIK поддержан новый класс:

Код	Наименование
-----	--------------

SDBP	МБ Валюта: Крупные сделки
------	---------------------------

Настройка Библиотеки расчета лимитов

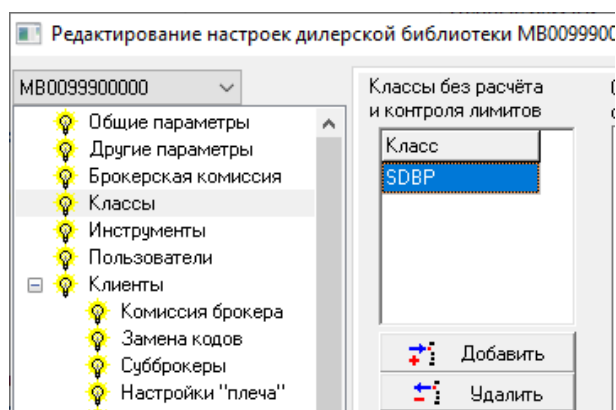
Для корректного расчета покупательной способности при работе с новыми классами необходимо выполнить настройку Библиотеки расчета лимитов.

Настройка Библиотеки расчета лимитов выполняется для фирмы Валютного рынка Московской биржи.

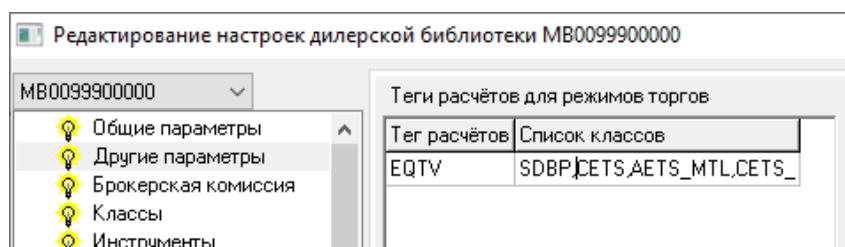
Запустите программу QUIK Administrator, откройте меню «Сервер QUIK» / «Библиотеки расчета лимитов» для соответствующей фирмы, выполните нижеописанные настройки.

Теги расчетов для режимов торгов

Если операции в данном режиме не нужно проверять и рассчитывать на позициях клиентов, добавьте класс SDBP на странице «Классы» в настройку «Классы без расчёта и контроля лимитов». Следующие пункты инструкции можно пропустить.

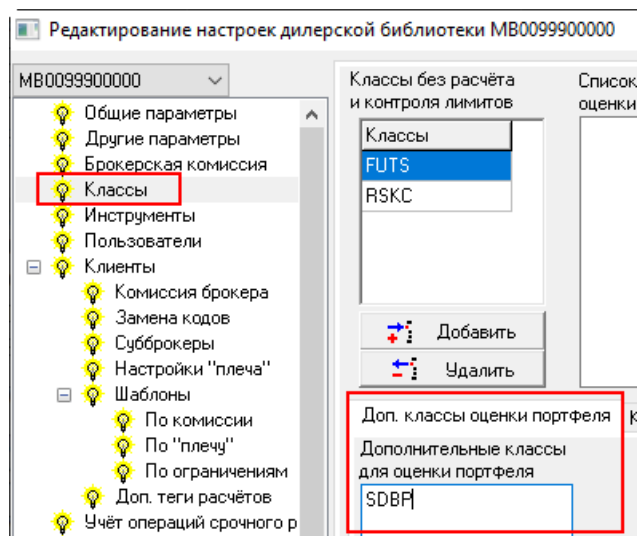


Если контроль и расчет операций необходим, то на странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» добавьте привязку класса SDBP к тегу расчетов (коду позиции), который используется для основных режимов торгов валютного рынка.



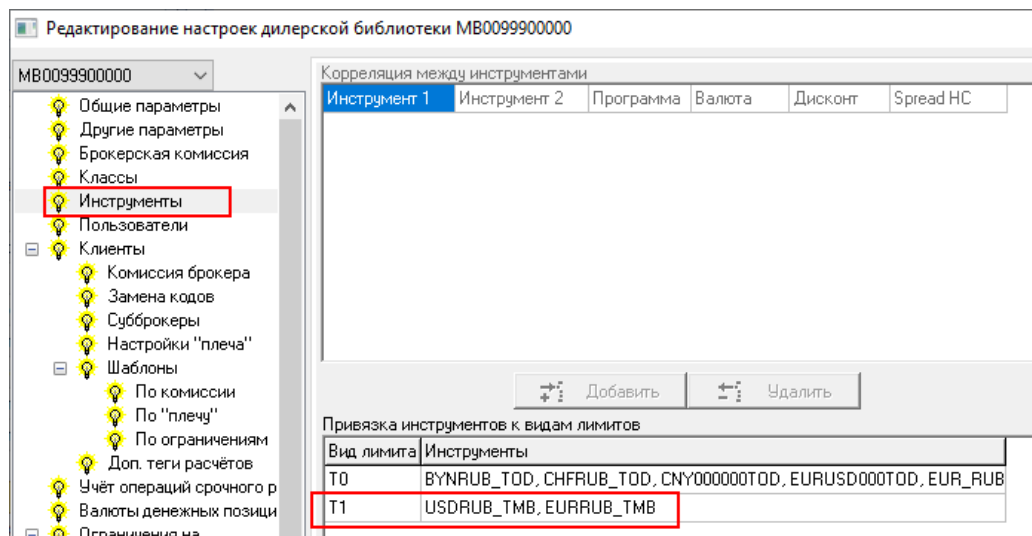
Дополнительные классы для оценки портфеля

На странице «Классы» в настройку «Дополнительные классы для оценки портфеля» добавьте код класса SDBP.



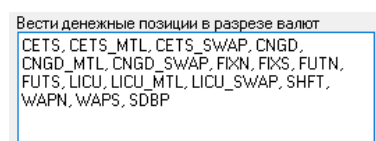
Привязка инструментов к видам лимита

Если контроль операций клиентов осуществляется при помощи функционала «Вид лимита», то на странице «Инструменты» в настройке «Привязка инструментов к видам лимитов» привяжите инструменты с кодами USDRUB_TMB, EURRUB_TMB к виду лимитов T1.



Настройка ведения позиций в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимов торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку класс SDBP.



Настройка валюты комиссии

Если на странице «Брокерская комиссия» заданы настройки «Валюта расчёта комиссии» и «Валюта списания комиссии» для основных режимов торгов валютного рынка, то добавьте класс SDBP в данные настройки.

Валюта	Список классов
SUR	SDBP, CETS, CETS_M

Добавить Удалить

Валюта	Список классов
SUR	SDBP, CETS, CETS_MTI

Добавить Удалить

7.5 Работа с классом ОТС

Общие сведения

Московская Биржа запустила режим для заключения внебиржевых сделок с провайдерами ликвидности и НКЦ. Для корректного расчета покупательной способности при работе с новым классом необходимо выполнить ряд настроек сервера и Библиотеки расчета лимитов.

Информация о классе приведена в таблице ниже:

Код	Наименование
ОТСТ	МБ Валюта: Рынок ОТС

Настройка Библиотеки расчета лимитов

Теги расчетов для режимов торгов

Если операции в данном режиме не нужно рассчитывать на позициях клиентов, добавьте класс ОТСТ в настройку «Классы без расчёта и контроля лимитов». Дальнейшие пункты инструкции можно пропустить.

Класс
ОТСТ

Добавить Удалить

Если же расчёт необходим, в разделе «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» добавьте привязку класса «ОТС» к тегу, который используется для основных режимов торгов валютного рынка.

Привязка классов и кодов расчета к видам лимита

Если лимитирование операций клиентов осуществляется с помощью настройки «Вид лимита», перейдите на закладку «Общие настройки» / «Часть 5» и привяжите класс «ОТС» к виду лимита T2 или к другому виду лимита с датой расчётов более 1 дня (например, T365).

Общие настройки библиотеки

Часть 1 Часть 2 Часть 3 Часть 4 Часть 5

Проверять обязательства по видам лимитов:

T0, T1, T2

Привязка классов к видам лимитов:

Вид лимита	Классы
T1	AETS_MTL, CETS, CETS_MTL, CNGD
T2	ОТС

Если в настройках данного рынка присутствуют только виды лимита T0 и T1 и необходим расчёт позиций в данном режиме, обратитесь на quiksupport@argatech.com за дальнейшими рекомендациями по настройке.

Настройка ведения позиций в разрезе валют

Откройте раздел «Классы» настроек БРЛ и добавьте класс «ОТС» в список «Вести денежные позиции в разрезе валют».

Вести денежные позиции в разрезе валют

AETS_MTL, CETS, CETS_MTL, CETS_SWAP, CNGD, CNGD_MTL, ОТС

Настройка валюты комиссии

Откройте раздел «Брокерская комиссия» настроек БРЛ и, если у Вас выполнены настройки «Валюта расчёта комиссии» и «Валюта списания комиссии» для класса «CETS», добавьте класс «ОТС» в данные настройки.

7.6 Работа с классом крупных внебиржевых сделок

Московская Биржа 17 февраля 2020 года запустила режим торгов крупными внебиржевыми сделками на валютном рынке. Режим аналогичен режиму ОТС для торгов с глобальными провайдерами ликвидности и предназначен для заключения сделок по инструменту EURUSD_SPT с объёмами заявок от 5 до 10 млн.

В системе QUIK поддержан класс:



Код	Наименование
OTCF	МБ Валюта: Крупные внебиржевые сделки

Настройка Библиотеки расчета лимитов

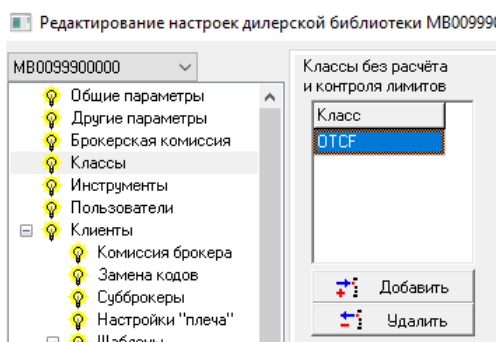
Для корректного расчета покупательной способности при работе с новым классом необходимо выполнить настройку Библиотеки расчета лимитов.

Настройка Библиотеки расчета лимитов выполняется для фирмы Валютного рынка Московской биржи.

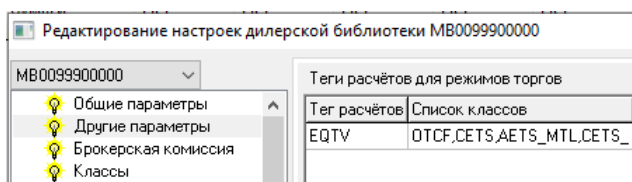
Запустите программу QUIK Administrator, откройте меню «Сервер QUIK» / «Библиотеки расчета лимитов» для соответствующей фирмы, выполните нижеописанные настройки.

Теги расчетов для режимов торгов

Если операции в данном режиме не нужно проверять и рассчитывать на позициях клиентов, добавьте класс OTCF на странице «Классы» в настройку «Классы без расчёта и контроля лимитов». Следующие пункты инструкции можно пропустить.



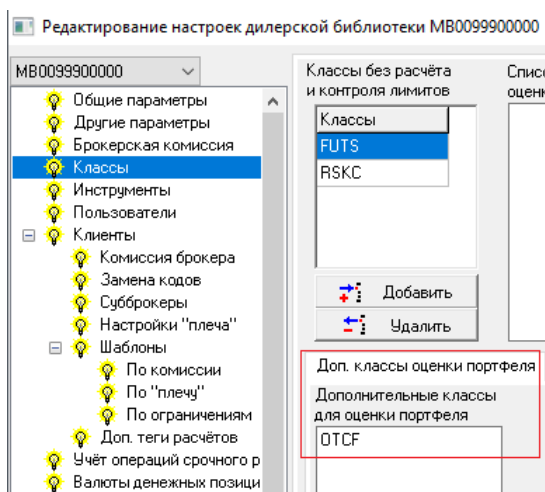
Если контроль и расчет операций необходим, то на странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» добавьте привязку класса OTCF к тегу, который используется для основных режимов торгов валютного рынка.



Дополнительные классы для оценки портфеля

На странице «Классы» в настройку «Дополнительные классы для оценки портфеля» добавьте код класса OTCF.

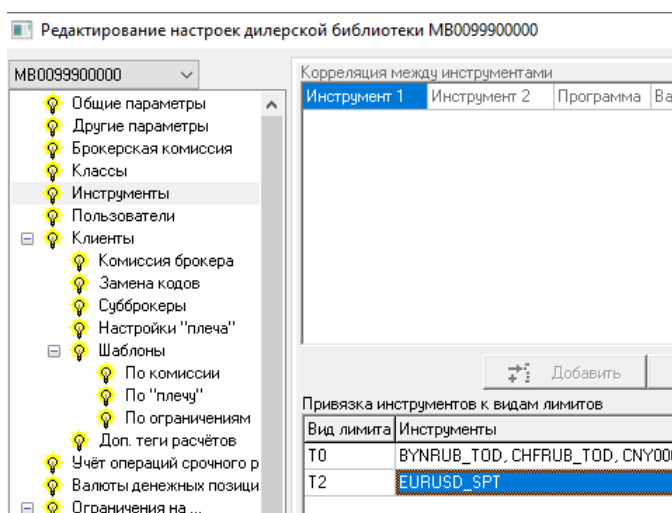




Привязка инструментов к видам лимита

Если контроль операций клиентов осуществляется при помощи функционала «Вид лимита», то на странице «Инструменты» в настройке «Привязка инструментов к видам лимитов» выполните привязку инструмента с кодом EURUSD_SPT к виду лимита. Для этого проверьте, по каким видам лимитов ведётся позиция в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов» на вкладке «Общие параметры/Часть 5».

- Если позиции свыше T1 не ведутся, то следует отказаться от торговли в данном режиме.
- Если позиции ведутся по видам лимитов T0, T1, T2 или T0, T1, T2, T365 или T0, T2, T365, то инструмент следует привязать к виду лимита T2:



- Если позиции ведутся по видам лимитов T0, T1, T365, либо T0, T365, то инструмент следует привязать к виду лимита T365.

Настройка ведения позиций в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку класс OTCF:



Вести денежные позиции в разрезе валют
AETS_MTL, CETS, CETS_MTL, CETS_SWAP,
CNGD, CNGD_MTL, EES_ILIS, SHFT, OTCF

Настройка валюты комиссии

Если на странице «Брокерская комиссия» заданы настройки «Валюта расчёта комиссии» и «Валюта списания комиссии» для основных режимов торгов валютного рынка, то добавьте класс OTCF в данные настройки.

7.7 Работа с классами мелких лотов

Общие сведения

Московская Биржа 29 марта 2021 года запустила режимы торгов по валютным парам USD/RUB и EUR/RUB с размером лота равным 1 центу.

В рамках поддержки в QUIK добавлены классы:

Код класса	Наименование (рус.)
CETS_SU	МБ Валюта: ETC (Центы)
CNGD_SU	МБ Валюта: РПС (Центы)
CNGDSWAP_SU	МБ Валюта: РПС (SWAP) (Центы)
LICU_SU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (Центы)
LICUSWAP_SU	МБ Валюта: Внесистемные сделки урегулирования (СВОПы) (Центы)

Настройка Библиотеки расчета лимитов

Привязка классов к видам лимита

На странице «Общие параметры» - «Часть 5», в настройке «Привязка классов к видам лимитов» необходимо привязать классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU к тому же сроку расчетов, к которому привязан класс основного режима торгов валютного рынка.



Общие настройки библиотеки

Часть 1 Часть 2 Часть 3 Часть 4 Часть 5

Проверять обязательства по видам лимитов:

T0, T1

Привязка классов к видам лимитов:

Вид лимита	Классы
T1	CETS, CNGD, CETS_SU, CNGD_SU.

Добавить Удалить

Теги расчетов для режимов торгов

На странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» необходимо привязать классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGD_SWAP_SU, LICU_SU, LICU_SWAP_SU к тому же тегу расчетов, что и класс основного режима валютного рынка, или к другому тегу, на котором должны учитываться операции по данным классам:

Теги расчётов для режимов торгов

Тег расчётов	Список классов
EQTV	S, CNGD, CETS_SU, CNGD_SU, CNGD_SWAP_SU, LICU_SU, LICU_SWAP_SU

Добавить Удалить

Привязка инструментов к видам лимита

На странице «Инструменты» в настройке «Привязка инструментов к видам лимитов» выполните привязку инструментов к сроку расчётов.

- Если в п.2.1 привязка классов была выполнена к виду лимита T0, добавьте инструменты USDRUB_TMS, EURRUB_TMS в настройку для вида лимитов T1;

Привязка инструментов к видам лимитов

Вид лимита	Инструменты
T1	USDRUB_TMS, EURRUB_TMS

- Если в п.2.1 привязка классов была выполнена к видам лимитов T1, добавьте инструменты USDRUB_TDS, EURRUB_TDS в настройку для вида лимитов T0.

Привязка инструментов к видам лимитов

Вид лимита	Инструменты
T0	USDRUB_TDS, EURRUB_TDS

Настройка ведения позиций в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку

классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU.

Вести денежные позиции в разрезе валют
CETS, CNGD, CETS_SU, CNGD_SU,
CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU

Настройка комиссии

1. На странице «Брокерская комиссия» добавьте классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU в настройку «Валюта расчёта комиссии» для валюты SUR:

Валюта	Список классов
SUR	CETS_SU, CNGD_SU,

Добавить Удалить

2. Если по новым классам комиссия должна учитываться на позиции по рублям, на странице «Брокерская комиссия» добавьте классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU также в настройку «Валюта списания комиссии»:

Валюта	Список классов
SUR	CETS_SU, CNGD_SU,

Не пров. при отл. вал. расчетов
Запр. опер. при нехв. сред. под ко
Разр. зак. поз. при нехв. ср. под ко

3. Для корректного учёта комиссии торговой системы при выставлении заявок необходимо на странице «Общие параметры» в разделе «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» добавить классы CETS_SU, CNGD_SU, CNGDSWAP_SU, LICU_SU, LICUSWAP_SU на вкладки «за орг. торг» и «клиринг» с необходимыми величинами комиссии торговой системы. Например, «0.00575» на вкладке «за орг. торг» и 0.00425 на вкладке «клиринг.».

7.8 Работа с классами RFS

В QUIK есть два класса относящихся к RFS системе:

Код	Наименование
-----	--------------

RFSP	МБ Валюта: Внебиржевые котировки RFS
------	--------------------------------------

RFSM	МБ Валюта: Внебиржевые сделки RFS
------	-----------------------------------

Класс с кодом RFSP транслируется **Программным интерфейсом RFS режима Валютного рынка Московской Биржи**, который обеспечивает подключение сервера системы QUIK к



торговой системе RFS Валютного рынка Московской Биржи и позволяет просматривать RFS котировки и принимать их.

Класс с кодом RFSP транслируется Торговым интерфейсом Валютного рынка Московской Биржи и используется для трансляции сделок, заключенных по валютным парам в RFS режиме.

Для корректного учета на позиции клиентов операций при работе с RFS классами необходимо выполнить настройку Библиотеки расчета лимитов.

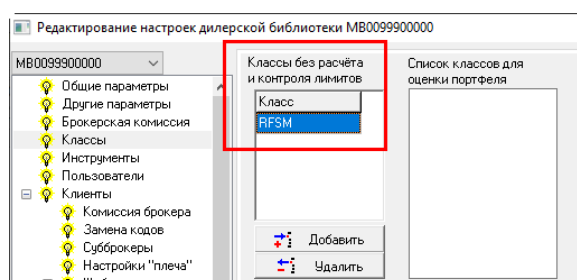
Настройка Библиотеки расчета лимитов выполняется для фирмы Валютного рынка Московской биржи.

Запустите программу QUIK Administrator, откройте меню «Сервер QUIK» / «Библиотеки расчета лимитов» для соответствующей фирмы, выполните нижеописанные настройки.

7.8.1 Настройка Библиотеки расчета лимитов при совместном использовании Программного интерфейса RFS режима Валютного рынка Московской Биржи и Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи

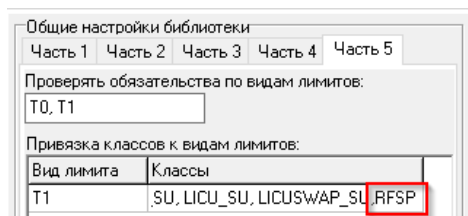
Классы без расчета и контроля лимитов

Добавьте класс RFSP в настройку «Классы» - «Классы без расчета и контроля лимитов».



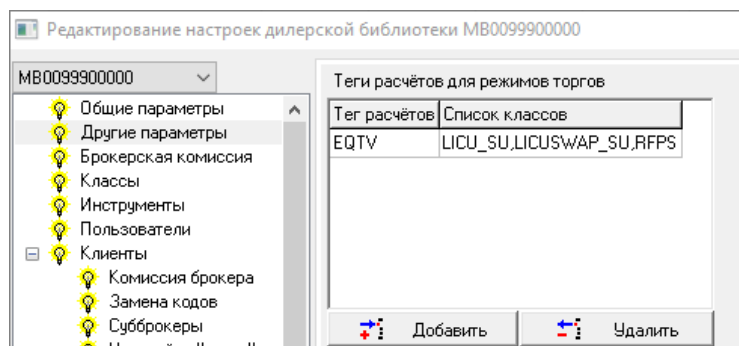
Привязка классов к видам лимита

На странице «Общие параметры» - «Часть 5», в настройке «Привязка классов к видам лимитов» необходимо привязать класс RFSP к тому же сроку расчетов, к которому привязан класс основного режима торгов валютного рынка CETS.



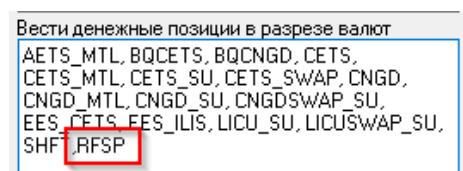
Теги расчетов для режимов торгов

На странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» необходимо привязать класс RFSP к тому же тегу расчетов, что и класс основного режима валютного рынка, или к другому тегу, на котором должны учитываться операции по данному классу:



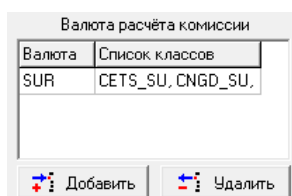
Настройка ведения позиций в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку класс RFSP.

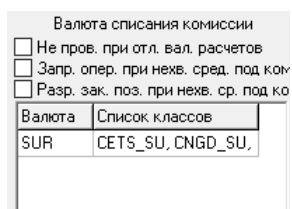


Настройка комиссии

4. На странице «Брокерская комиссия» добавьте класс RFSP в настройку «Валюта расчёта комиссии» для валюты SUR:



5. Если по классу комиссия должна учитываться на позиции по рублям, на странице «Брокерская комиссия» добавьте класс RFSP также в настройку «Валюта списания комиссии»:



6. Если опция «Общие параметры» - «Часть 1» - «Использовать комиссию ТС» не установлена, но комиссию торговой системы по сделкам необходимо списывать



с позиции клиента, то на странице «Общие параметры» в разделе «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» добавьте класс RFSP на вкладку «за орг. торг» с необходимыми величинами комиссии торговой системы. Например, «0.0016».

Класс	Комиссия
RFSP	0.0016

7.8.2 Настройка Библиотеки расчета лимитов при использовании Торгового интерфейса Валютного рынка Московской Биржи без Программного интерфейса RFS режима Валютного рынка Московской Биржи

Привязка классов к видам лимита

На странице «Общие параметры» - «Часть 5», в настройке «Привязка классов к видам лимитов» необходимо привязать класс RFSM к тому же сроку расчетов, к которому привязан класс основного режима торгов валютного рынка CETS.

Вид лимита	Классы
T1	AETS_MTL, CETS, RFSM, CETS_MTL

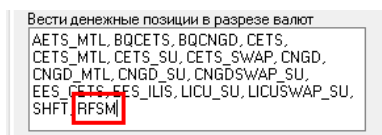
Теги расчетов для режимов торгов

На странице «Другие параметры» в списке «Теги расчетов для режимов торгов» необходимо привязать класс RFSM к тому же тегу расчетов, что и класс основного режима валютного рынка, или к другому тегу, на котором должны учитываться операции по данному классу:

Тег расчётов	Список классов
EQTV	CETS, RFSM, AETS_MTL, CETS_MTL

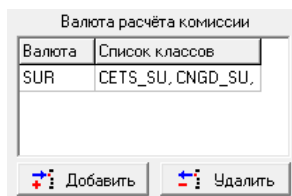
Настройка ведения позиций в разрезе валют

Если на странице «Классы» в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» присутствуют основные режимы торгов валютного рынка, добавьте в данную настройку класс RFSM.

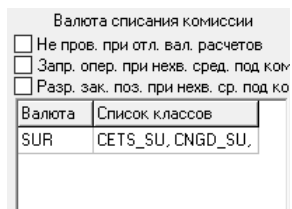


Настройка комиссии

7. На странице «Брокерская комиссия» добавьте класс RFSM в настройку «Валюта расчёта комиссии» для валюты SUR:



8. Если по классу комиссия должна учитываться на позиции по рублям, на странице «Брокерская комиссия» добавьте класс RFSM также в настройку «Валюта списания комиссии»:



9. Если опция «Общие параметры» - «Часть 1» - «Использовать комиссию ТС» не установлена, но комиссию торговой системы по сделкам необходимо списывать с позиции клиента, то на странице «Общие параметры» в разделе «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» добавьте класс RFSM на вкладку «за орг. торг» с необходимыми величинами комиссии торговой системы. Например, «0.0016».

