ARQA TECHNOLOGIES

Терминальный модуль доверительного управляющего «TrustManager»

Руководство пользователя

Версия 2.11

quik

Содержание

1. Общие сведения 6
   1.1 Возможности программы 6
   1.2 Принцип работы 6
   1.3 Основные окна программы и их назначение 8
   1.4 Подготовка к работе 10

2. Группы клиентов 12
   2.1 Принципы работы 12
   2.2 Таблица «Группы клиентов» 13
   2.3 Таблица «Активы по группе [ ]» 20
   2.4 Таблица «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])» 22
   2.5 Таблица «Позиции на срочном рынке по группе клиентов [ ]» 25
   2.6 Таблица «Торговые счета по инструменту [ ] (в группе [ ])» 26
   2.7 Таблица «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов [ ]» 28
   2.8 Таблица «Торговые счета по ограничению типа [ ] (в группе [ ])» 29
   2.9 Таблица «Информация по активам» 31
   2.10 Таблица «Сводная таблица по группам» 33

3. Группы инструментов 35
   3.1 Принцип работы 35
   3.2 Таблица «Группы инструментов» 36
   3.3 Действия с группами инструментов 38
   3.4 Управление группами инструментов из внешних приложений 42

4. Состав группы инструментов 43

5. Ограничения 44
   5.1 Таблица «Ограничения по клиентам» 45
   5.2 Таблица «Ограничения по группам клиентов» 47
   5.3 Таблица «Список ограничений» 49
   5.4 Действия с ограничениями 51

5.5 Управление ограничениями из внешних приложений 56
5.6 Таблица «Выполнение условий ограничения» 57

6. Торговые операции 58
6.1 Операции с групповыми заявками 58
6.2 Таблица «Групповые заявки» 67
6.3 Таблица «Заявки по групповой заявке [ ]» 70
6.4 Операции с групповыми стоп-заявками 71
6.5 Таблица «Групповые стоп-заявки» 76
6.6 Таблица «Стоп-заявки по групповой стоп-заявке [ ]» 81
6.7 Операции с заявками «по исполнению» 84
6.8 Операции с групповыми адресными заявками 87
6.9 Операции с групповыми адресными заявками РЕПО 89
6.10 Таблица «Групповые адресные внебиржевые заявки» 92
6.11 Таблица «Адресные заявки по групповой адресной заявке [ ]» 96
6.12 Таблица «Адресные внебиржевые заявки РЕПО по групповой адресной заявке РЕПО [ ]» 98
6.13 Операции с групповыми безадресными заявками РЕПО 99
6.14 Таблица «Групповые безадресные внебиржевые заявки» 101
6.15 Таблица «Безадресные внебиржевые заявки РЕПО по групповой безадресной заявке РЕПО [ ]» 105
6.16 Пулы заявок 106
6.17 Таблица «Пулы заявок» 108
6.18 Таблица «Заявки в пуле [ ]» 109
6.19 Специальные виды поручений 111

7. Данные 115
7.1 Загруженные инструменты 115
7.2 Загруженные позиции 117
7.3 Экспорт ограничений 119

8. Сообщения 121
8.1 Предупреждения о нарушении ограничений 121

9. Настройки программы 123

9.1 Общие 123
9.2 Торговля 124
9.3 Ограничения 128
9.4 Хранение данных 129
9.5 Импорт данных 129
9.6 Дополнительно 133

10. Форматы файлов для импорта данных 133
10.1 Импорт групп инструментов 133
10.2 Импорт описаний инструментов и цен 136
10.3 Импорт дополнительных позиций по инструментам 137
10.4 Импорт дополнительных денежных позиций 138
10.5 Импорт ограничений 139
10.6 Импорт эталонных портфелей 144
10.7 Импорт транзакций 144
10.8 Импорт пулов заявок 150
10.9 Импорт описаний рейтинговых агентств 153
10.10 Файл с параметрами айсберг-заявок 156

11. Формирование кода эмитента 157
11.1 Эмиссионные бумаги, требующие регистрации 157
11.2 Эмиссионные бумаги, не требующие регистрации 158
11.3 Ценные бумаги субъектов РФ и муниципальные ЦБ 158
11.4 Облигации ЦБ РФ 159
11.5 Облигации федерального займа 159

12. Хранимые процедуры 159
12.1 Добавление клиента в группу 159
12.2 Удаление клиента из группы 160
12.3 Удаление группы клиентов 161
12.4 Добавление группы инструментов 161
12.5 Изменение параметров группы инструментов 163
12.6 Удаление группы инструментов 164
12.7 Добавление элемента в группу инструментов 166

12.8 Удаление элемента из группы инструментов 168
12.9 Добавление ограничения 169
12.10 Изменение ограничения 171
12.11 Удаление ограничения 173

13. Приложения 174
13.1 Миграция данных из MS SQL в PostgreSQL 174
13.2 Ограничения на минимальный объем заявок 175
13.3 Идентификаторы предопределенных групп инструментов 175
13.4 Примеры вызова хранимой процедуры CreateNewRestriction 177

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

1. Общие сведения

TrustManager является дополнительным модулем Рабочего места QUIK, предназначенным для осуществления одинаковых торговых операций по нескольким счетам клиентов на фондовом и срочном рынках и для наблюдения за их позициями.

1.1 Возможности программы

TrustManager предоставляет следующие возможности:

- Объединение счетов в группы, просмотр индивидуальных и суммарных активов для групп клиентов.
- Ввод заявок различных типов по группе клиентов и их автоматическое распределение по индивидуальным счетам пропорционально активам клиентов либо в соответствии с заданными весовыми коэффициентами клиентов.
- Участие в аукционах путем использования адресных заявок.
- Ввод специализированных поручений – закрытие короткой позиции на фондовом рынке и закрытие позиции на срочном рынке.
- Замена и снятие заявок и стоп-заявок по выбранному клиенту и по группе клиентов.
- Объединение инструментов в группы. Установка и контроль ограничений на долю заданной группы активов в портфеле определенного клиента, либо в портфелях клиентов, входящих в группу.
- Динамическая переоценка стоимости активов на счетах клиентов и суммарной стоимости портфелей.
- Использование маржинального кредитования в групповых заявках.
- Динамический импорт транзакций из файла.
- Динамический экспорт данных из таблиц через DDE-сервер.

1.2 Принцип работы

Общая схема работы с программой выглядит следующим образом:

1. В системе QUIK задаются позиции клиентов по инструментам и денежным средствам, а также лимиты маржинального кредитования. Создание позиций выполняется таким же образом, как и при обслуживании клиентов через систему интернет-трейдинга (подробнее см. Руководство пользователя системы QUIK, Раздел 7). Позиции клиентов могут быть загружены из учетной системы (бэк-офиса) брокера при помощи «Загрузки лимитов из файла».

   После того, как в системе QUIK заданы позиции клиентов, они становятся доступны для модуля TrustManager.

2. В TrustManager производится объединение кодов клиентов (для срочного рынка – торговых счетов клиентов) в группы клиентов, каждая из которых соответствует определенной стратегии доверительного управления. Для просмотра суммарных активов группы используются специальные таблицы, также возможен просмотр активов в разрезе клиентов или инструментов.

   - Для групп фондового рынка доступны групповые транзакции на фондовом рынке, а также просмотр суммарных и индивидуальных активов входящих в группу клиентов на фондовом рынке.
   - Для групп срочного рынка доступны групповые транзакции на срочном рынке, просмотр суммарных и индивидуальных активов и открытых позиций на срочном рынке клиентов, входящих в группу.
   - Для членов универсальных групп доступны транзакции и просмотр активов как на фондовом, так и на срочном рынках. В суммарном портфеле группы этого вида суммируются активы фондового рынка, имеющиеся у членов группы, а также денежные остатки членов группы на срочном рынке.

3. Для одновременного совершения торговых операций по группе счетов клиентов используются групповые заявки (групповые стоп-заявки, групповые адресные заявки, групповые адресные заявки РЕПО, групповые безадресные заявки РЕПО).

   В групповой заявке указывается суммарный объем заявки по всей группе клиентов. При обработке групповой заявки, ее общий объем разделяется между членами группы, после чего программа выставляет в торговую систему одновременно несколько индивидуальных заявок – по заявке от каждого члена группы.

   Для обычных групп клиентов объем групповой заявки разделяется между членами группы пропорционально доле активов каждого клиента в активах группы. Пропорции формируются автоматически по заданным правилам, при этом учитываются заданные в Рабочем месте QUIK ограничения на минимальный объем заявки, и если у клиента недостаточный объем средств, то он исключается из групповой заявки, а объем исключенных заявок распределяется между заявками остальных клиентов (для айсберг-заявок данные ограничения не учитываются). Перед выставлением заявки в торговую систему пропорции могут редактироваться и вручную (подробнее см. групповые заявки). Таким образом, имеется возможность для групп клиентов с фиксированными долями самостоятельно задавать весовые коэффициенты, в соответствии с которыми будет производиться разделение объема заявок.

   Поддерживается возможность применения маржинального кредитования в групповых заявках. Предусмотрены специальные поручения для закрытия коротких позиций на фондовом рынке и закрытия позиций на срочном рынке.

4. Состояние исполнения групповой заявки отображается в таблице «Групповые заявки» («Групповые стоп-заявки», «Групповые адресные внебиржевые заявки», «Групповые безадресные внебиржевые заявки»). По каждой групповой заявке можно посмотреть состояние исполнения входящих в неё индивидуальных заявок, открыв соответствующую таблицу из контекстного меню («Заявки по групповой заявке [ ]», «Заявки по групповой стоп-заявке [ ]», «Адресные заявки по групповой адресной заявке [ ]»). Результаты

обработки поручений на ввод и снятие заявки, а также подтверждения исполнения заявки отображаются в «Окне сообщений».

5. В TrustManager можно объединять торговые инструменты в группы (см. «Группы инструментов»), чтобы создавать ограничения разных типов.
6. Ограничение представляет собой условие, накладываемое на размер активов, входящих в одну из групп инструментов, и может задаваться сверху, снизу (не более либо не менее определенной величины, в денежном выражении или в % от стоимости), либо создавать запрет на торговлю данной группой инструментов. Ограничения могут являться дополнительным условием при распределении групповой заявки, используются для расчета доступного количества актива при выставлении новой заявки, а также для автоматического контроля доли определенной группы активов в портфеле клиента или группы клиентов. Если объем заявки нарушает ограничение, то он автоматически снижается до допустимого уровня, либо такая заявка отвергается. Текущее состояние активов клиента проверяется на соблюдение ограничений с настраиваемой периодичностью. Предупреждения о нарушении ограничений отображаются в окне «Нарушения ограничений».
7. Данные из большинства таблиц программы можно экспортировать в MS Excel в режиме реального времени для дальнейшей обработки собственными формулами и макросами.
8. Ввод и снятие групповых заявок могут осуществляться собственной торговой системой брокера, взаимодействующей с TrustManager при помощи импорта транзакций из текстового файла.
9. Многопользовательский режим работы. Для работы нескольких терминалов QUIK с модулем TrustManager с одной базой данных, содержащей информацию о группах пользователей, группах инструментов и установленных ограничениях, можно задействовать многопользовательский режим. Для поддержки такой работы необходимо установить в настройках модуля (пункт меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Хранение данных») флажок «Поддержка многопользовательской работы» и в качестве базы данных всем терминалам указать одну и ту же базу данных. При этом вся первоначальная настройка (создание групп пользователей, групп инструментов, ограничений) должна производиться с какого-то одного терминала (другие терминалы TrustManager при этом не должны быть запущены). После первоначальной настройки всех групп и ограничений возможна одновременная работа нескольких терминалов.

1.3 Основные окна программы и их назначение

Доступ к функциям модуля TrustManager осуществляется из главного меню Рабочего места QUIK. При наличии необходимых файлов и прав на работу с данным модулем, в меню программы появится дополнительный пункт меню **Расширения / TrustManager**, содержащий подпункты:

- «Группы клиентов…» – открыть таблицу со списком групп, в которые объединены клиентские счета.
- «Информация по активам…» – открыть таблицу с текущим состоянием активов выбранной группы клиентов.

- «Сводная таблица…» — открыть таблицу для отслеживания состояния портфелей клиентов.
- «Группы инструментов…» – открыть таблицу со списком групп, в которые объединены инструменты (используется для контроля ограничений).
- «Удаление групп инструментов…» – удалить группу инструментов с заданными условиями.
- «Ограничения по клиентам…» – открыть таблицу ограничений по клиентам.
- «Ограничения по группам клиентов…» – открыть таблицу ограничений по группам клиентов.
- «Удаление ограничений…» – удалить ограничения с заданными условиями.
- «Информация по ограничениям…» – открыть таблицу «Информация по ограничениям».
- «Нарушения ограничений…» – открыть таблицу сообщений по нарушениям ограничений.
- «Групповые заявки…» – открыть таблицу с перечнем отправленных групповых заявок.
- «Групповые стоп-заявки…» – открыть таблицу с перечнем отправленных групповых стоп-заявок.
- «Групповые адресные внебиржевые заявки…» – открыть таблицу с перечнем отправленных групповых адресных внебиржевых заявок.
- «Групповые безадресные внебиржевые заявки…» – открыть таблицу с перечнем отправленных групповых безадресных внебиржевых заявок.
- «Пулы заявок…» – открыть таблицу со списком пулов заявок, загруженных из файла.
- «Подать групповую заявку…» – открыть форму для ввода новой групповой заявки.
- «Подать групповую стоп-заявку…» – открыть форму для ввода новой групповой стоп-заявки.
- «Подать групповую адресную заявку…» – открыть форму для ввода новой групповой адресной заявки.
- «Подать групповую адресную заявку РЕПО…» – открыть форму для ввода новой групповой адресной заявки РЕПО.
- «Подать групповую безадресную заявку РЕПО…» – открыть форму для ввода новой групповой безадресной заявки РЕПО.
- «Закрыть короткую позицию…» – открыть окно подачи поручения на закрытие коротких позиций, открытых на фондовом рынке.
- «Закрыть позицию на срочном рынке…» – открыть окно подачи поручения на закрытие либо сокращения открытых позиций на срочном рынке.
- «Купить/Продать долю актива…» – открыть окно подачи поручения на покупку / продажу доли актива в портфеле группы. Эта команда также может использоваться для закрытия длинных позиций на фондовом рынке.
- «Загруженные инструменты…» – открыть таблицу с информацией о загруженных инструментах.
- «Загруженные позиции…» – открыть таблицу с информацией о загруженных позициях.
- «Экспорт ограничений…» – выгрузка в файл ограничений с разными условиями.
- «Настройки…» – открыть окно редактирования настроек программы.

1.3.1 Действия над таблицами

Для работы с таблицами модуля TrustManager применимы стандартные действия с таблицами Рабочего места QUIK:

- «Ctrl»+«E» – редактировать таблицу;
- «Ctrl»+«F» – поиск в таблице;
- «Ctrl»+«P» – вывод данных таблицы на печать;
- «Ctrl»+«W» – подобрать ширину столбцов по данным;
- Сортировка столбцов нажатием левой кнопкой мыши на заголовке столбца, удерживая нажатой клавишу «Ctrl»;
- Перемещение таблиц на другую закладку;
- Копирование данных таблиц в буфер обмена;
- Вывод данных через DDE сервер;
- Экспорт через ODBC;
- Режим связанных окон (подробнее см. Руководство пользователя системы QUIK, Раздел 2).

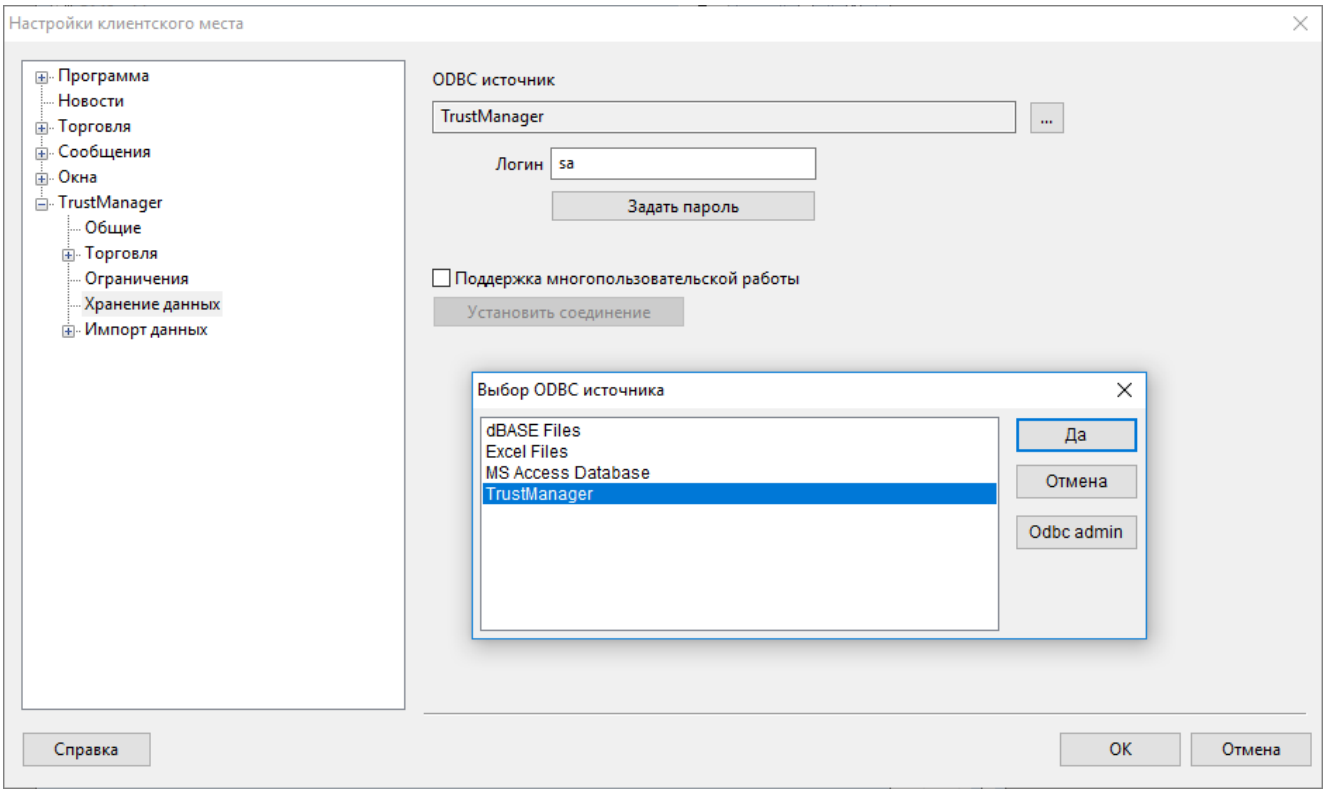
Ниже приведён список таблиц, которые могут быть основными, и таблиц, которые могут быть связанными с основными таблицами:

Основная таблица	**Фильтры**	**Связанные таблицы**
Группы клиентов	Фильтр групп клиентов	_ Активы по группе; _ Лимиты на срочном рынке по группе; _ Позиции на срочном рынке по группе.
Активы по группе клиентов	Фильтр групп клиентов; Фильтр по инструменту	_ Клиенты по активу;
Лимиты на срочном рынке по группе	Фильтр групп клиентов; Фильтр по типу ограничения	_ Торговые счета по ограничению
Позиции на срочном рынке по группе	Фильтр групп клиентов; Фильтр по инструменту	_ Торговые счета по инструменту

1.4 Подготовка к работе

1. Закройте Рабочее место QUIK.
2. Скопируйте файл **TM.dll** в папку Рабочего места QUIK.
3. Установите пакет MS Access 2000 или более новый. СУБД MS Access используется для хранения настроек программы о группах клиентов, группах инструментов, ограничений и групповых заявках.

4. Скопируйте файл **TM.mdb** из комплекта поставки в папку Рабочего места QUIK. Этот файл используется для хранения информации по созданным группам пользователей, групповым заявкам, группам инструментов и ограничениям. Обращение к нему осуществляется через интерфейс ODBC, который нужно настроить следующим образом:



- В меню Рабочего места QUIK выберите пункт меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**.
- В открывшемся окне выберите вкладку «Хранение данных».
- Нажмите на кнопку «…» справа от поля «ODBC источник». В открывшемся окне нажмите на кнопку «ODBC Admin», на экране появится окно «Администратор источников данных ODBC», в котором нужно добавить базу данных как новый источник ODBC.
- Нажмите кнопку «Добавить», выберите драйвер «Microsoft Access Driver (*.mdb)». Нажмите кнопку «Готово».
- Укажите имя источника данных «TrustManager». Нажмите кнопку «Выбрать» и укажите путь к файлу с базой данных. Флажки «Только чтение» и «Монопольный доступ» должны быть сняты.
- Нажмите кнопку «OK» для сохранения настроек. В списке источников данных появится запись «TrustManager». Нажмите кнопку «OK».
- В окне «Выбор ODBC-источника» выберите «TrustManager» и нажмите кнопку «Да».
- Если для подключения к источнику требуется авторизация, то введите логин и пароль в соответствующие поля (подробнее см. п. 9.4).
- Если планируется работа нескольких пользователей TrustManager с общей базой данных, то включите признак «Поддержка многопользовательской работы».
- Закройте окно настроек нажатием кнопки «OK».

- Перезапустите Рабочее место QUIK для применения настроек. При успешном подключении к базе в «Окне сообщений» появится уведомление «Соединение с БД установлено».

> **TrustManager также может поддерживать работу с базами данных MS SQL и PostgreSQL. За настройками и инструкциями по созданию таких баз данных обращайтесь в Службу поддержки QUIK по электронной почте quiksupport@arqatech.com.**
>
> **Для переноса данных из существующей базы данных на MS SQL в новую базу данных на PostgreSQL предусмотрена возможность миграции данных, описание см. в п. 13.1.**

2. Группы клиентов

2.1 Принципы работы

2.1.1 Назначение группы клиентов

Группой клиентов называется некое множество кодов клиентов, управление средствами которых осуществляется по единым правилам. Группы клиентов используются для формирования пакета поручений (**групповой заявки**) по нескольким счетам клиентов, включенным в группу. Как правило, группа клиентов объединяет счета, управляемые по одной стратегии.

По умолчанию в TrustManager группы клиентов создаются отдельно для фондового и срочного рынков. Это связано с тем, что позиции клиентов на фондовом рынке контролируются сервером системы QUIK, а на срочном – непосредственно торговой системой биржи.

В программе возможно лишь ограниченное объединение позиций групп клиентов на срочном и фондовом рынках – создание **универсальных групп**. Фактического объединения активов групп клиентов не происходит, так как позиции клиентов на фондовом рынке контролируются сервером системы QUIK, а на срочном – непосредственно торговой системой биржи. Но существует возможность производить суммирование активов с целью получения общей аналитики по группе, а также выставлять заявки на транзакции на обеих площадках от имени одной и той же группы. Оценка портфеля универсальных групп складывается из оценки активов на фондовом рынке и денежного остатка на срочном рынке. Оценка позиций на срочном рынке не производится, учитывается лишь свободный остаток денежных средств. По фондовому рынку осуществляется оценка полностью всех активов.

2.1.2 Работа с группами клиентов

Для просмотра списка сформированных групп предназначена таблица «Группы клиентов». Эта же таблица используется для создания и редактирования групп клиентов.

Двойное нажатие левой кнопки мыши на строке таблицы «Группы клиентов» открывает таблицу «Активы по группе [ ]», содержащую информацию о совокупных активах группы клиентов по всем счетам, в разрезе активов.

Двойное нажатие левой кнопки мыши на строке таблицы «Активы по группе [ ]» открывает таблицу «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])», содержащую информацию об индивидуальных позициях клиентов по данному активу.

Использование групп клиентов в групповых заявках описано в п. «Торговые операции».

2.1.3 Использование универсальных групп

Для возможности использования в своей работе универсальных групп необходимо произвести соответствующую настройку в основном меню программы. Поддержка объединённых групп включается в меню **Расширения / TrustManager / Настройки...** на вкладке «Общие». Если поставить флажок «Разрешить объединенные группы клиентов», то в формах создания и редактирования групп клиентов становится доступной опция «Объединённая группа», выбор которой означает преобразование группы в универсальную.

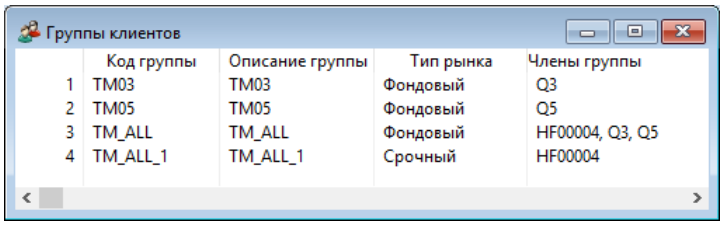
2.2 Таблица «Группы клиентов»

меню **Расширения / TrustManager / Группы клиентов...**

2.2.1 Назначение таблицы

Таблица предназначена для просмотра списка групп клиентов, добавления, редактирования и удаления групп.

2.2.2 Формат таблицы



	Код группы	Описание группы	Тип рынка	Члены группы
1	TM03	TM03	Фондовый	Q3
2	TM05	TM05	Фондовый	Q5
3	TM_ALL	TM_ALL	Фондовый	HF00004, Q3, Q5
4	TM_ALL_1	TM_ALL_1	Срочный	HF00004

Каждая строка таблицы отображает информацию по отдельной группе клиентов. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код группы	Код группы
Описание группы	Описание группы

Заголовок	Назначение
Тип рынка	Тип группы. Возможные значения: _ Срочный; _ Фондовый; _ Все(срочн.) – в универсальную группу была преобразована срочная группа; _ Все (фонд.) – в универсальную группу была преобразована фондовая группа
Члены группы	Список кодов клиентов, включенных в группу

2.2.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.2.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

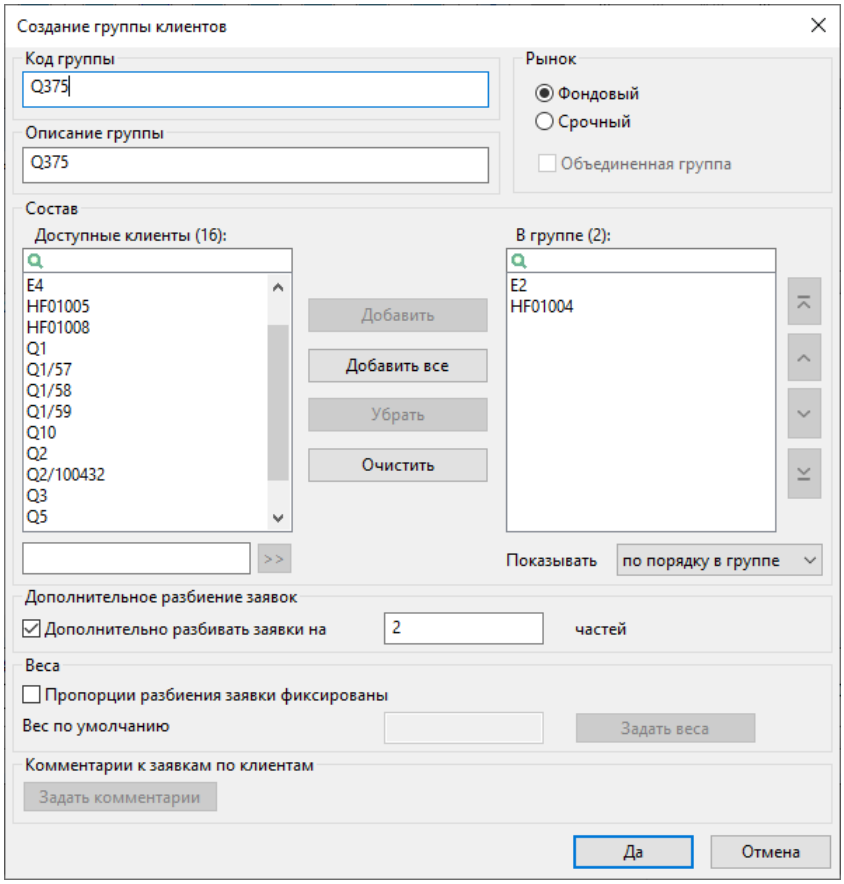
- «Показать позиции на фондовом рынке» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Активы по группе [ ]» для группы клиентов в выбранной строке, если группа относится к фондовому рынку.
- «Показать позиции на срочном рынке» – открыть таблицу «Позиции на срочном рынке по группе» для группы клиентов в выбранной строке, если группа относится к срочному рынку.
- «Показать лимиты на срочном рынке» – открыть таблицу «Лимиты на срочном рынке по группе» для группы клиентов в выбранной строке, если группа относится к срочному рынку.
- «Свернуть позиции» – закрыть таблицы с позициями или лимитами, открытые для группы клиентов из выбранной строки. Функция доступна, если для группы клиентов открыта хотя бы одна из таблиц: «Активы по группе [ ]», «Позиции на срочном рынке по группе клиентов», «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов».
- «Показать информацию по активам» – открыть таблицу «Информация по активам» с текущим состоянием активов выбранной группы клиентов.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода новой групповой заявки.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода новой групповой стоп-заявки.
- «Новая групповая адресная заявка» – открыть окно ввода групповой адресной заявки.
- «Новая групповая адресная заявка РЕПО» – открыть окно ввода новой групповой адресной заявки РЕПО.
- «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» – открыть окно ввода новой групповой безадресной заявки РЕПО.

- «Купить/Продать долю актива» – открыть окно ввода заявки на покупку / продажу доли актива в портфеле группы.
- «Добавить группу клиентов» – открыть окно создания новой группы клиентов.
- «Изменить группу клиентов» – редактировать группу клиентов в выбранной строке.
- «Удалить» / «Удалить группу клиентов» (или двойное нажатие правой кнопки мыши на строке таблицы) – удалить группу клиентов в выбранной строке.
- «Удалить» / «Удаление групп клиентов» – открыть окно удаления групп клиентов.
- «Удалить» / «Удаление клиентов из групп» – открыть окно удаления клиентов из групп.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.2.5 Создание группы клиентов

Новая группа пользователей создается выбором в таблице «Группы клиентов» пункта контекстного меню «Добавить группу клиентов». В результате на экране появится окно со следующими параметрами:



1. «Код группы» – сокращенное наименование группы клиентов для использования в групповых заявках.
2. «Описание группы» – расширенное наименование группы.
3. «Рынок» – выбор типа инструментов для группы (фондовый либо срочный), которым определяется список доступных кодов клиентов.

4. «Объединённая группа» – если флажок включен, то создаваемая группа имеет статус универсальной. Универсальная группа может быть преобразована из фондовой или срочной группы.

> **Флажок «Объединённая группа» доступен, если в настройках модуля разрешено объединение позиций клиентов на фондовом и срочном рынках. Для объединённых групп денежная позиция на срочном рынке объединяется с денежной позицией по «Т0» на фондовом рынке.**

5. «Состав» – выбор состава группы:

   - «Доступные клиенты» – список кодов клиентов, доступных для данного рынка. Вверху списка доступно поле для быстрого поиска, записи в списке фильтруются по вводимой подстроке.
   - Поле под списком «Доступные клиенты» используется для добавления кода клиента, не заданного на сервере QUIK.
   - «В группе» – список кодов клиентов, включенных в группу. Вверху списка доступно поле для быстрого поиска, записи в списке фильтруются по вводимой подстроке.
   - «Показывать» – настроить отображение кодов клиентов в поле «В группе»:
     - «По порядку в группе» (по умолчанию) – коды клиентов отображаются в соответствии с фактически имеющимся порядком;
     - «В алфавитном порядке» – коды клиентов отображаются в алфавитном порядке. В данном режиме меняется порядок отображения клиентов в группе, но не меняется их фактический порядок.

6. «Дополнительное разбиение заявок»:

   - «Дополнительно разбивать заявки на … частей» – при установленном флажке появляется возможность разбиения каждой клиентской заявки на указанное количество частей. Таким образом, при выставлении групповой заявки, её объем будет разбиваться на индивидуальные заявки для каждого клиента группы, но вместе с тем объем заявки каждого клиента будет разбиваться на указанное количество равных частей.

     Пример:

     Например, если указанное в поле число равно 3, и по клиентам С1, С2, С3, С4 подготовлены заявки О1, О2, О3, О4, то они будут разбиты так:

```
О1=О11+О12+О13,
О2=О21+О22+О23,
О3=О31+О32+О33,
О4=О41+О42+О43
```

     и вместо подачи заявок О1, О2, О3, О4 (предположим, порядок заявок должен быть именно таким) будут поданы заявки в таком порядке:

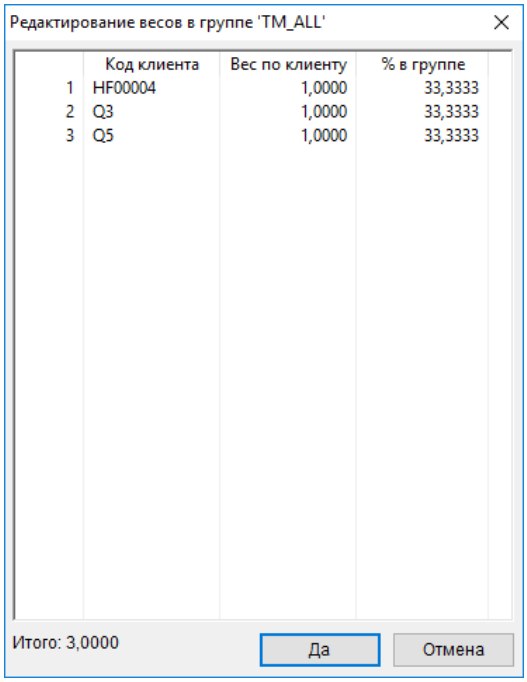
```
O11, O21, O31, O41, O12, O22, O32, O42, O13, O23, O33, O43
```

(то есть сначала первые трети всех заявок, потом вторые трети всех заявок и только потом последние трети всех заявок).

> **Использование данной опции способствует лучшему перемешиванию заявок от клиентов. Если заявки подаются в общем порядке (без дробления на части индивидуальных заявок), то клиентам, заявки по которым подаются первыми, предоставляются льготные условия, а последним клиентам может не хватить объёма или их заявки сыграют по худшей цене.**

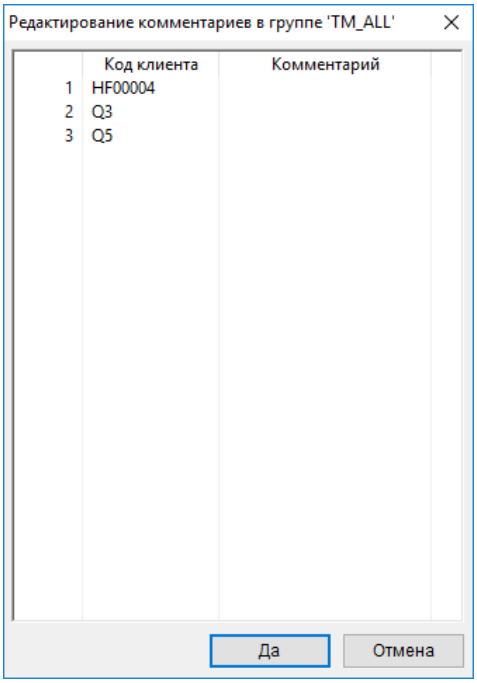
7. «Веса»:

- «Пропорции разбиения заявки фиксированы» – задание правила разбиения групповых заявок (стоп-заявок) на индивидуальные.
  - Если флажок снят, то пропорция разбиения групповой заявки определяется соотношением текущих активов клиентов.
  - Если флажок выставлен, то пропорция разбиения жёстко зафиксирована. Доли, на которые делится любая групповая заявка, всегда прямо пропорциональны заданным весовым коэффициентам клиентов в группе.
- «Вес по умолчанию» – весовой коэффициент, который автоматически присваивается всем добавляемым в группу клиентам. Изменения, вносимые в это поле, не отражаются на весовых коэффициентах ранее добавленных клиентов.
- Нажатие кнопки «Задать веса» откроет окно «Редактирование весов», в котором можно вручную задать весовые коэффициенты клиентов. Чтобы редактировать поле в колонке «Вес по клиенту», нажмите дважды левую кнопку мыши.
  В колонке «% в группе» отображается процентное соотношение между долями клиентов. В поле «Итого» отображается сумма весов всех клиентов в группе.



8. «Комментарии к заявкам по клиентам»:

- Нажатием кнопки «Задать комментарии» открывается окно ввода примечаний к кодам клиентов данной группы. В этом окне для каждого клиента в группе можно ввести текстовый комментарий, который будет указываться на всех индивидуальных заявках, сформированных по данной группе клиентов. Для одинаковых кодов клиентов, входящих в разные группы, значения примечаний могут различаться. Чтобы ввести значение в поле в колонке «Комментарий», нажмите дважды левую кнопку мыши. Длина комментария ограничена 20 символами. Для возможности настройки комментариев должна быть включена настройка «Использовать комментарии при подаче заявок».



Создание группы завершается нажатием кнопки «Да». Новая группа отобразится в таблице «Группы клиентов».

2.2.6 Редактирование группы клиентов

Созданную ранее группу можно редактировать – добавлять и удалять коды клиентов, а также изменять присвоенные клиентам весовые коэффициенты. Значения полей «Код группы» и «Рынок» изменению не подлежат.

Для редактирования группы выделите соответствующую ей строку в таблице «Группы клиентов», затем выберите в контекстном меню пункт «Изменить группу клиентов».

Изменение состава группы не влияет на состояние активных групповых заявок.

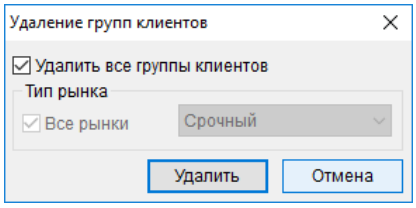
2.2.7 Удаление группы клиентов

Для удаления группы выделите соответствующую ей строку в таблице «Группы клиентов», затем выберите пункт контекстного меню «Удалить / Удалить группу клиентов».

Удаление группы не влечет за собой снятия активных групповых заявок.

2.2.8 Удаление групп клиентов

Для удаления групп клиентов выберите в таблице «Группы клиентов» пункт контекстного меню «Удалить / Удаление групп клиентов…».



В открывшемся окне задайте условия:

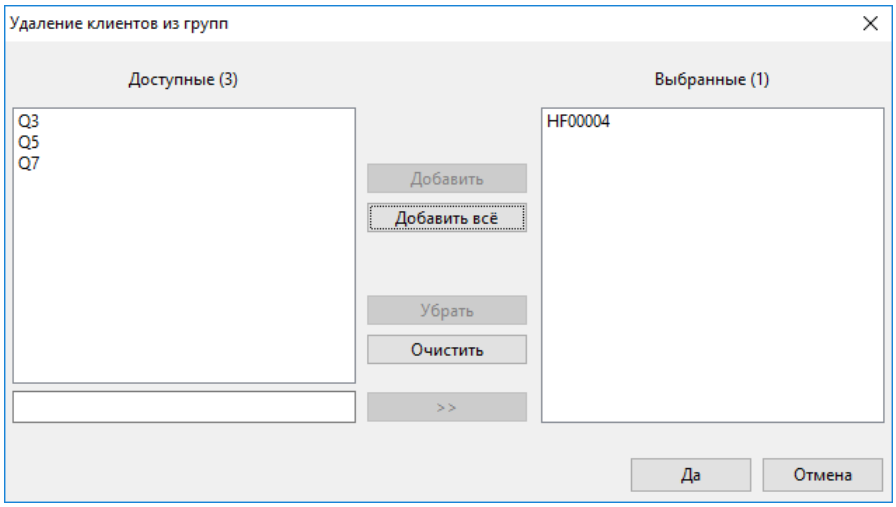
1. «Удалить все группы клиентов» – по умолчанию флажок установлен и при этом фильтр «Все рынки» недоступен.
2. «Тип рынка» – выбор типа рынка, по которому будут удалены группы клиентов. Если установлен флажок «Все рынки», выбор типа рынка недоступен.

При нажатии на кнопку «Удалить» происходит удаление всех групп клиентов, удовлетворяющих заданным условиям.

Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без удаления групп клиентов.

2.2.9 Удаление клиентов из групп

Для удаления клиентов из всех имеющихся групп выберите в таблице «Группы клиентов» пункт контекстного меню «Удалить / Удаление клиентов из групп…».



В открывшемся окне «Удаление клиентов из групп» сформируйте список удаляемых клиентов, выделяя в списке доступных необходимые коды клиентов и нажимая кнопку «Добавить».

Нажатием кнопки «Добавить все» в список выбранных перемещаются все доступные коды клиентов.

Поле, расположенное под списком доступных кодов клиентов, предназначено для ввода кода клиента (имеющегося в списке доступных) вручную, для дальнейшего его добавления в список выбранных кодов клиентов.

Для удаления одного кода клиента из списка выбранных достаточно выделить его и нажать кнопку «Убрать», либо дважды нажать на нем левую кнопку мыши. Чтобы удалить все коды клиентов из списка, нажмите кнопку «Очистить».

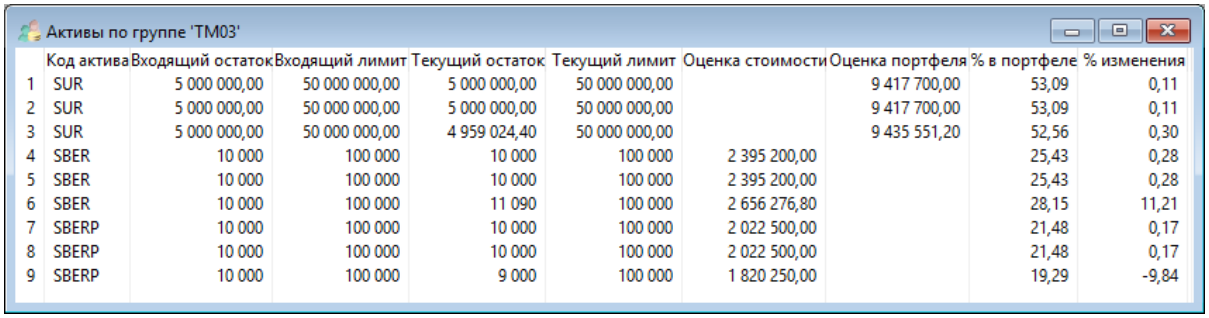
При нажатии на кнопку «Да» происходит удаление выбранных кодов клиентов из всех групп клиентов.

Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без удаления клиентов из групп.

2.3 Таблица «Активы по группе [ ]»

2.3.1 Назначение таблицы

Таблица «Активы по группе [ ]» предназначена для просмотра состояния суммарных активов по всем клиентам, включенным в данную группу.


Активы по группе 'TM03'

	Код актива	Входящий остаток	Входящий лимит	Текущий остаток	Текущий лимит	Оценка стоимости	Оценка портфеля	% в портфеле	% изменения
1	SUR	5 000 000,00	50 000 000,00	5 000 000,00	50 000 000,00		9 417 700,00	53,09	0,11
2	SUR	5 000 000,00	50 000 000,00	5 000 000,00	50 000 000,00		9 417 700,00	53,09	0,11
3	SUR	5 000 000,00	50 000 000,00	4 959 024,40	50 000 000,00		9 435 551,20	52,56	0,30
4	SBER	10 000	100 000	10 000	100 000	2 395 200,00		25,43	0,28
5	SBER	10 000	100 000	10 000	100 000	2 395 200,00		25,43	0,28
6	SBER	10 000	100 000	11 090	100 000	2 656 276,80		28,15	11,21
7	SBERP	10 000	100 000	10 000	100 000	2 022 500,00		21,48	0,17
8	SBERP	10 000	100 000	10 000	100 000	2 022 500,00		21,48	0,17
9	SBERP	10 000	100 000	9 000	100 000	1 820 250,00		19,29	-9,84

Таблица открывается из таблицы «Группы клиентов» выбором пункта контекстного меню «Показать позиции на фондовом рынке» или двойным нажатием левой кнопки мыши на строке с нужной группой.

2.3.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному инструменту. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код актива	Идентификатор инструмента в торговой системе биржи
Наименование актива	Наименование инструмента в торговой системе
Входящий остаток	Сумма значений собственных средств клиентов группы по данному инструменту, до совершения сделок

Заголовок	Назначение
Входящий лимит	Сумма значений доступных клиентам группы заемных средств по данному инструменту, до совершения сделок
Текущий остаток	Сумма значений собственных средств клиентов по данному инструменту, с учетом сделок
Текущий лимит	Сумма значений доступных клиентам заемных средств по данному инструменту, с учетом сделок
Заблокировано	Суммарный объем средств, заблокированных для исполнения активных заявок клиентов
Оценка стоимости	Суммарная оценка стоимости активов клиента по данному инструменту
Оценка портфеля	Суммарная оценка портфеля (сумма оценок стоимости всех инструментов)
% в портфеле	Доля данного инструмента в суммарном портфеле группы клиентов
% изменения	Процент изменения суммы текущего остатка собственных средств клиента по данному инструменту по отношению к сумме на начало торговой сессии
* Кол-во РЕПО	Количество лотов в сделках РЕПО, которые клиенты обязаны выкупить
* Оценка РЕПО	Оценка денежных средств клиентов, которые клиенты потратят на обратный выкуп
* Дельта по РЕПО	Разница между оценкой средств в сделках РЕПО и ценой их обратного выкупа
* Оц. стоимости с РЕПО	Оценка стоимости актива с учётом средств, которые необходимо затратить на обратный выкуп
Срок расчётов	Срок расчетов

Поля, отмеченные звездочкой (*), включаются в таблицу, если включен режим учета сделок РЕПО (установлен флажок «Учет сделок РЕПО» в диалоге настроек **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Общие»).

Строка с денежной позицией, в которой показывается оценка портфеля называется основной денежной позицией.

Для объединённых групп деньги на срочном рынке показываются в составе строки с основной денежной позицией.

Если выключена настройка «Объединять только денежные позиции», то для объединённых групп дополнительно показывается строка с фиктивным денежным активом «Инстр. срочн. рынка», в качестве кода валюты которой показывается основная валюта, значения «Входящий остаток» и «Текущий остаток» равны ликвидационной стоимости инструментов

срочного рынка, остальные поля не используются. Данная строка суммируется при получении значения оценки портфеля.

2.3.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.
4. «Показывать нулевые позиции» – признак отображения активов с нулевыми позициями, у которых текущий остаток равен нулю. По умолчанию флажок включен.

2.3.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать активы клиентов» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])» с информацией по выбранному инструменту.
- «Свернуть активы клиентов» – закрыть открытую таблицу «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])» с информацией по выбранному инструменту.
- «Новая групповая заявка» / <код инструмента> (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая стоп-заявка» / <код инструмента> (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая адресная заявка» / <код инструмента> – открыть окно ввода групповой адресной заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая адресная заявка РЕПО» / <код инструмента> – открыть окно ввода групповой адресной заявки РЕПО по указанному инструменту.
- «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» / <код инструмента> – открыть окно ввода групповой безадресной заявки РЕПО по указанному инструменту.
- «Купить/Продать долю актива» / <код инструмента> – открыть окно ввода заявки на покупку / продажу доли актива в портфеле группы.
- «Закрыть короткую позицию» – создать поручение для закрытия короткой позиции, открытой на фондовом рынке.

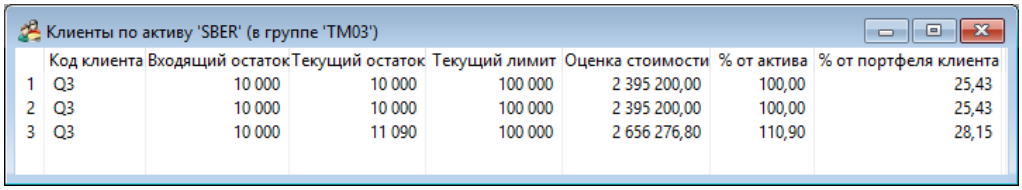
Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.4 Таблица «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])»

2.4.1 Назначение таблицы

Таблица «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])» предназначена для просмотра остатков по выбранному инструменту на счетах клиентов одной группы.

Таблица открывается из таблицы «Активы по группе [ ]» выбором пункта контекстного меню «Показать активы клиентов» или двойным нажатием левой кнопкой мыши на строке с нужным активом.



	Код клиента	Входящий остаток	Текущий остаток	Текущий лимит	Оценка стоимости	% от актива	% от портфеля клиента
1	Q3	10 000	10 000	100 000	2 395 200,00	100,00	25,43
2	Q3	10 000	10 000	100 000	2 395 200,00	100,00	25,43
3	Q3	10 000	11 090	100 000	2 656 276,80	110,90	28,15

Каждая строка таблицы соответствует отдельному коду клиента. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	**Назначение**
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Наименование актива	Наименование инструмента в торговой системе, совпадает с кодом инструмента
Счет депо	Номер торгового счета, на котором отражаются операции клиента по данному инструменту
Входящий остаток	Собственные средства клиента по данному инструменту до совершения сделок
Входящий лимит	Величина доступных клиенту заемных средств по данному инструменту до совершения сделок
Текущий остаток	Собственные средства клиента по данному инструменту, с учетом сделок
Текущий лимит	Величина доступных клиенту заемных средств по данному инструменту, с учетом сделок
Заблокировано	Объем средств, заблокированных для исполнения активных заявок по данному инструменту
Оценка стоимости	Суммарная оценка стоимости активов клиента по данному инструменту. Для денежных активов параметр не содержит значений и в таблице не показывается
Оц.портфеля клиента	Для актива «SUR» отображается суммарная оценка портфеля (сумма оценок стоимости всех инструментов). Для остальных денежных активов поле не заполняется, для инструментов – не отображается
% от актива	Доля данного инструмента в суммарном активе группы клиентов
% от портфеля клиента	Доля данного инструмента в портфеле клиента
* Кол-во РЕПО	Количество лотов в сделках РЕПО, которые клиент обязан выкупить
* Оценка РЕПО	Оценка денежных средств клиента, которые клиент потратит на обратный выкуп

Заголовок	Назначение
* Дельта по РЕПО	Разница между оценкой средств в сделках РЕПО и ценой их обратного выкупа
* Оц. стоимости с РЕПО	Оценка стоимости актива с учётом средств, которые необходимо затратить на обратный выкуп средств
Срок расчётов	Срок расчетов

Поля, отмеченные звездочкой (*), включаются в таблицу, если включен режим учета сделок РЕПО (установлен флажок «Учет сделок РЕПО» в диалоге настроек **Расширение / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Общие»)

2.4.2 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Показывать нулевые позиции» – признак отображения активов с позициями, у которых текущий остаток равен нулю. По умолчанию флажок включен.
4. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.
5. «Фильтр клиентов» – фильтр кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента».

2.4.3 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать информацию по активам» – открыть таблицу «Информация по активам» с текущим состоянием активов выбранного клиента.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая адресная заявка» – открыть окно ввода групповой адресной заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая адресная заявка РЕПО» – открыть окно ввода групповой адресной заявки РЕПО по указанному инструменту.
- «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» – открыть окно ввода групповой безадресной заявки РЕПО по указанному инструменту.
- «Купить/Продать долю актива» – открыть окно ввода заявки на покупку / продажу доли актива в портфеле группы.

- «Закрыть короткую позицию» – создать поручение для закрытия короткой позиции, открытой на фондовом рынке.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.5 Таблица «Позиции на срочном рынке по группе клиентов [ ]»

2.5.1 Назначение

Просмотр суммарных позиций на срочном рынке по определенной группе клиентов (срочного рынка либо объединенной). Таблица вызывается из таблицы «Группы клиентов» выбором пункта контекстного меню «Показать позиции на срочном рынке».

Таблица формируется на основе данных таблицы «Позиции по клиентским счетам» Рабочего места QUIK (см. Руководство пользователя QUIK, Раздел 3) путём суммирования информации по позициям клиентов, входящих в заданную группу.

2.5.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию о позиции по отдельному активу. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код актива	Идентификатор инструмента в торговой системе
Наименование актива	Наименование инструмента в торговой системе, совпадает с кодом инструмента
Позиция на начало	Общее количество контрактов в открытых позициях на начало торгов
Тек. позиция	Общее количество контрактов в открытых позициях на текущий момент, с учетом сделок **«Тек. позиция» = «Тек. позиция на покупку» – «Тек. позиция на продажу»**
Тек. позиция на покупку	Количество контрактов, купленных в текущей торговой сессии
Тек. позиция на продажу	Количество контрактов, проданных в текущей торговой сессии
Акт. на покупку	Количество контрактов в активных заявках на покупку
Акт. на продажу	Количество контрактов в активных заявках на продажу
Вариац. маржа	Оценка размера вариационной маржи (изменения стоимости позиции клиента в денежном выражении с учетом котировок)

2.5.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.5.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать торговые счета» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Торговые счета по инструменту [ ] (в группе [ ])» с разбивкой позиции по выбранному инструменту по торговым счетам.
- «Свернуть торговые счета» – закрыть открытую ранее таблицу «Торговые счета по инструменту [ ] (в группе [ ])» по данному инструменту.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки по инструменту.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки по инструменту.
- «Закрыть позицию» – создать поручение для закрытия позиции на срочном рынке по инструменту.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.6 Таблица «Торговые счета по инструменту [ ] (в группе [ ])»

2.6.1 Назначение

Просмотр позиции по определенному инструменту срочного рынка для указанной группы клиентов в разрезе торговых счетов. Таблица открывается из таблицы «Позиции на срочном рынке по группе клиентов [ ]» выбором пункта контекстного меню «Показать торговые счета».

2.6.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию по отдельному активу. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Торговый счет	Код торгового счета
Код актива	Идентификатор инструмента в торговой системе

Заголовок	Назначение
Наименование актива	Наименование инструмента в торговой системе, совпадает с кодом инструмента
Позиция на начало	Общее количество контрактов в открытых позициях на начало торгов
Тек. позиция	Общее количество контрактов в открытых позициях на текущий момент, с учетом сделок **«Тек. позиция» = «Тек. позиция на покупку» – «Тек. позиция на продажу»**
Тек. позиция на покупку	Количество контрактов в открытых длинных (на покупку) позициях до совершения сделок в текущей сессии
Тек. позиция на продажу	Количество контрактов в открытых коротких (на продажу) позициях до совершения сделок в текущей сессии
Акт. на покупку	Количество контрактов в активных заявках на покупку
Акт. на продажу	Количество контрактов в активных заявках на продажу
Вариац. маржа	Оценка размера вариационной маржи (изменения стоимости позиции клиента в денежном выражении с учетом котировок)

2.6.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Фильтр клиентов» – фильтр кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента».

2.6.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки по инструменту.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки по инструменту.
- «Закрыть позицию» – создать поручение для закрытия позиции на срочном рынке по указанному инструменту.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.7 Таблица «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов [ ]»

2.7.1 Назначение

Просмотр суммарных лимитов на срочном рынке по определенной группе клиентов (срочного рынка либо объединенной). Таблица вызывается из таблицы «Группы клиентов» выбором пункта контекстного меню «Показать лимиты на срочном рынке».

Таблица формируется на основе данных таблицы «Ограничения по клиентским счетам» Рабочего места QUIK (см. Руководство пользователя QUIK, Раздел 3) путём суммирования информации по ограничениям на операции по счетам клиентов, входящих в заданную группу.

2.7.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию об ограничении (лимите) по отдельному активу. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Тип лимита	Тип лимита для срочного рынка: _ «Ден. средства» – стоимость денежных средств в обеспечении, _ «Залоговые ден. средства» – стоимость залоговых средств в обеспечении, _ «Клиринговые ден. средства» – стоимость клиринговых денежных средств в обеспечении, _ «Клиринговые залоговые ден. средства» – стоимость клиринговых залоговых средств в обеспечении, _ «Лимит открытых позиций на спот-рынках» – стоимость открытых позиций на спот-рынках, _ «Неизвестный тип» – все прочие типы ограничений срочного рынка
Пред. лим. откр. поз.	Лимит открытых позиций по всем инструментам предыдущей торговой сессии в денежном выражении
Лим. откр. поз.	Текущий лимит открытых позиций по всем инструментам в денежном выражении. Для рынка RTS Standard отображается лимит на покупку спотовых активов
Тек. чист. поз.	Совокупное денежное обеспечение, резервируемое под открытые позиции и торговые операции текущей сессии. Для рынка RTS Standard учитываются только позиции по главным спот-активам («Главными» называются контракты на спот-активы на рынке RTS Standard, для которых в текущую торговую сессию доступно осуществление торговых операций в безадресном режиме)
План. чист. поз.	Планируемые чистые позиции по всем инструментам в денежном выражении. Соответствует параметру «Свободные средства» рынка FORTS
Вариац. маржа.	Вариационная маржа по позициям клиента, по всем инструментам

Заголовок	Назначение
Накопл. доход	Накопленный доход на клиентском счете, рассчитываемый для операций со срочными контрактами
Валюта	Валюта на ограничениях по клиентским счетам

2.7.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.7.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для экспорта вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать торговые счета» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Торговые счета по ограничению типа [ ] (в группе [ ])» с разбивкой ограничения выбранного типа по торговым счетам.
- «Свернуть торговые счета» – закрыть открытую ранее таблицу «Торговые счета по ограничению типа [ ] (в группе [ ])» по данному инструменту.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.8 Таблица «Торговые счета по ограничению типа [ ] (в группе [ ])»

2.8.1 Назначение

Просмотр ограничений определенного типа для указанной группы клиентов срочного рынка в разрезе торговых счетов. Таблица открывается из таблицы «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов [ ]» выбором пункта контекстного меню «Показать торговые счета» или двойным нажатием левой кнопки мыши на строке.

2.8.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию об ограничении (лимите) по отдельному активу. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Торговый счет	Код торгового счета
Тип лимита	Тип лимита для срочного рынка. Значения такие же, как и в таблице «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов [ ]»
Коэф. ликвид.	Коэффициент, определяющий, какая часть средств блокируется из залогового, а какая – из собственного денежного лимита. Коэффициент представляет собой число от 0 до 1. Например, если коэффициент равен 0.7, то заблокируется 70% в собственном денежном лимите и 30% – в залоговом. Параметр относится к рынку FORTS
Пред. лим. откр. поз.	Лимит открытых позиций по всем инструментам предыдущей торговой сессии в денежном выражении
Лим. откр. поз.	Текущий лимит открытых позиций по всем инструментам в денежном выражении. Для рынка RTS Standard отображается лимит на покупку спотовых активов
Тек. чист. поз.	Совокупное денежное обеспечение, резервируемое под открытые позиции и торговые операции текущей сессии. Для рынка RTS Standard учитываются только позиции по главным спот-активам
План. чист. поз.	Планируемые чистые позиции по всем инструментам в денежном выражении. Соответствует параметру «Свободные средства» рынка FORTS
Вариац. маржа.	Вариационная маржа по позициям клиента, по всем инструментам
Накопл. доход	Накопленный доход на клиентском счете, рассчитываемый для операций со срочными контрактами
Валюта	Валюта на ограничениях по клиентским счетам

2.8.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Фильтр клиентов» – фильтр кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента».

2.8.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.9 Таблица «Информация по активам»

меню **Расширения / TrustManager / Информация по активам**

2.9.1 Назначение

Таблица предназначена для отображения информации по активам на счетах выбранного клиента либо группы клиентов. Таблица имеет два режима отображения:

- по отдельным инструментам – отображение позиций по инструментам. Позиции по активу суммируются по всем фирмам и торговым счетам. Если в настройках включен режим «Отображать дополнительные позиции» (меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Общие»), то такие позиции также отображаются в таблице. Позиции на срочном рынке отображаются только для объединенных групп клиентов.
- по группам инструментов – отображение оценок стоимости позиций по группам инструментов. В таблице отображаются группы инструментов, в которые входит хотя бы один инструмент, отобранный по приведенным выше правилам.

2.9.2 Формат таблицы

В строках таблицы отображаются позиции по активам либо группам инструментов.
В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код актива	Код инструмента, для денежных позиций – код валюты. Параметр режима отображения «По инструментам»
Наименование актива	Наименование инструмента, для денежных позиций – код валюты из таблицы кросс-курсов (если валюта в ней указана), либо «Денежные средства». Параметр режима отображения «По инструментам»
Код группы инструментов	Код группы инструментов. Параметр режима отображения «По группам инструментов»
Описание группы	Описание группы инструментов. Параметр режима отображения «По группам инструментов»
Текущий остаток	Позиция по инструменту. Параметр режима отображения «По инструментам»
Оценка стоимости	Денежная оценка позиции по активу
% в портфеле	Отношение доли стоимости актива к оценке стоимости портфеля клиента либо к сумме портфелей групп клиентов.
ЭП, позиция	Позиция клиента (группы клиентов) по активу в эталонном портфеле. Параметр режима отображения «По инструментам»
ЭП, оценка	Денежная оценка стоимости позиции по активу в эталонном портфеле

Заголовок	Назначение
ЭП, дельта	Разница между «Оценкой стоимости» и «ЭП, оценка» по данному активу в денежном выражении
ЭП, дельта в %	Отношение «ЭП, дельта» к «Оценка стоимости», в %
ЭП, доля в %	Отношение «ЭП, оценка» к стоимости эталонного портфеля, в %
Срок расчётов	Срок расчетов

При установленном в настройках таблицы флажке «Показывать итоговую информацию» в последней строке таблицы «Итого:» отображаются суммарные значения по всем параметрам, кроме «Текущий остаток» и «ЭП, позиция».

2.9.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Активы по» – способ отображения активов в таблице:

   - «Клиенту» – в таблице отображаются активы выбранного клиента. Код клиента должен быть выбран из расположенного ниже списка.
   - «Группе клиентов» – в таблице отображаются активы выбранной группы клиентов. Код группы должен быть выбран из расположенного ниже списка.

   Если параметр был изменен, то при сохранении изменений программа предложит изменить заголовок таблицы в соответствии с выбранными параметрами.

3. «Режим отображения» – способ группировки активов:

   - «По инструментам» – в таблице отображаются позиции по отдельным инструментам.
   - «По группам инструментов» – в таблице отображаются денежные оценки стоимости позиций по группам инструментов.
   - «Фильтр групп инструментов» – фильтр значений таблицы по полю «Код группы инструментов». Для настройки фильтра установите флажок или нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные». Окно «Поиск» ниже списка кодов предназначено для поиска значений в списке. Фильтр имеет дополнительные параметры настройки:
     - «Включать в список выбранные» – в таблице будут отображены коды групп, перечисленные в списке «Выбранные».
     - «Исключать из списка выбранные» – в таблице будут отображены все коды групп, за исключением перечисленных в списке «Выбранные».
     - «Фильтровать по префиксу» – если признак выключен, то фильтр распространяется на точные совпадения значений с указанными в списке «Выбранные»; если признак включен, то фильтр распространяется на все значения, начинающиеся с указанных в фильтре комбинаций символов.

     Фильтр доступен в режиме отображения по группам инструментов.

4. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.
5. «Показывать нулевые позиции» – признак отображения позиций, у которых текущий остаток равен нулю. Если флажок включен, то в режиме отображения «По инструментам» отображаются позиции по всем активам, присутствующим в Таблицах лимитов для клиента (для групп клиентов – имеющимся хотя бы у одного клиента в группе), а в режиме отображения «По группам инструментов» отображаются все группы, включающие в себя хотя бы один инструмент из числа имеющихся. Если флажок выключен, то в таблице отображаются только активы (группы инструментов), имеющие ненулевую текущую позицию у клиента (для групп клиентов – хотя бы у одного клиента группы). По умолчанию флажок включен.
6. «Показывать итоговую информацию» – признак отображения суммарных данных по всем отображаемым позициям. По умолчанию выключен.
7. «Не учитывать НКД» – при установленном флажке при расчёте оценки стоимости облигаций НКД не учитывается. При этом в общей оценке стоимости портфеля НКД для облигаций учитывается всегда.
8. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.9.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки по указанному инструменту.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки по указанному инструменту.
- «Купить/Продать долю актива» – открыть окно ввода заявки на покупку / продажу доли актива в портфеле группы.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

2.10 Таблица «Сводная таблица по группам»

меню **Расширения / TrustManager / Сводная таблица…**

2.10.1 Назначение

Таблица предназначена для отслеживания состояния портфелей клиентов (в том числе определение текущей доли различных активов в этих портфелях). Сводная таблица содержит данные по группам клиентов, клиентам этих групп и состоянием их портфелей (включая сравнение с полными портфелями клиентов и портфелями групп клиентов).

2.10.2 Формат таблицы

Таблица заполняется данными по всем имеющимся группам клиентов (кроме групп срочного рынка). Внутри каждой группы перебираются все клиенты этой группы. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
* Код группы	Код группы инструментов
Описание группы	Расширенное наименование группы инструментов
* Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
* Код актива	Код инструмента для бумаг или код валюты для денег
* Счёт депо	Счёт депо. Для валют показывается Группа
Наименование актива	Наименование актива. Для валют показывается наименование валюты
* Срок расчётов	Срок расчетов
Входящий лимит	Входящий лимит в портфеле клиента
Текущий лимит	Текущий лимит в портфеле клиента
* Входящий остаток	Входящий остаток в портфеле клиента
* Текущий остаток	Текущий остаток в портфеле клиента
* Заблокировано	Заблокировано активов в портфеле клиента
* Оценка стоимости	Оценка стоимости в портфеле клиента
* % от портфеля клиента	Доля данного инструмента в портфеле клиента
* % от портфеля группы	Доля данного инструмента в стоимости портфеля группы клиентов
* % от актива в группе	Доля данного инструмента в суммарном активе группы клиентов
* % изменения	Изменение оценки стоимости актива клиента
* % изменения в группе	Процент изменения суммы текущего остатка собственных средств клиента по данному инструменту по отношению к сумме на начало торговой сессии
* Оценка портфеля	Для актива «SUR» отображается суммарная оценка портфеля (сумма оценок стоимости всех инструментов). Для остальных денежных активов поле не заполняется, для инструментов – не отображается

* — параметры отображаются по умолчанию

2.10.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.

2.10.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

3. Группы инструментов

3.1 Принцип работы

Группа инструментов предназначена для контроля структуры активов какого-либо клиента или группы клиентов при помощи ограничений. Группа инструментов может объединять инструменты разных классов ценных бумаг.

> **В группу инструментов не предусмотрено добавление инструментов срочного рынка.**

В TrustManager заданы несколько типов предопределенных групп инструментов:

Первая группа:

- <Money> – Денежные активы;
- <Stocks> – Все акции;
- <Bonds> – Все облигации.

> **Принадлежность инструментов к этим группам определяется в соответствии с настройками класса инструментов, в который входят эти инструменты.**

Вторая группа:

- <StocksCom> – Обыкновенные акции;
- <StocksPref> – Привилегированные акции;
- <BondsCorp> – Корпоративные облигации;
- <BondsMun> – Муниципальные облигации;
- <BondsExch> – Биржевые облигации;

- <BondsMFO> – МФО облигации;
- <BondsCB> – Облигации ЦБ;
- <BondsRF> – Облигации РФ;
- <BondsRegRF> – Облигации субъектов РФ;
- <MutFundsOpen> – ПИФы открытые;
- <MutFundsClos> – ПИФы закрытые;
- <MutFundsInt> – ПИФы интервальные;
- <RDR> – РДР;
- <Foreign fund> – Иностранные фонды;
- <ETC> – Товарные инструменты.

> **Принадлежность инструментов к этим группам определяется согласно информации, транслируемой только Московской Биржей (параметр «Тип инстр-та» в таблице «Текущие торги»).**

Использование предопределенных групп не отличается от групп, заданных пользователем.

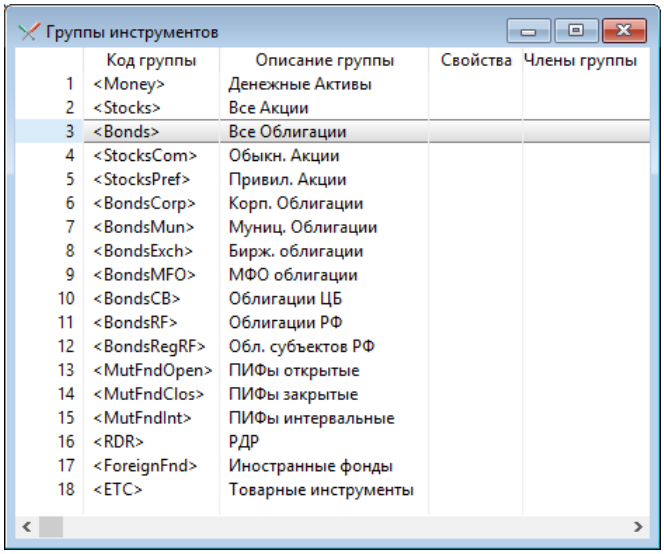
> 1. **Для корректного отображения состава предопределенной группы инструментов, просьба обращать внимание на признаки, установленные на классах инструментов в программе QUIK Administrator.**
> 2. **При импорте инструментов из текстового файла, загруженные инструменты добавляются в состав предопределенных групп:**
>   - Инструменты без указания типа – в группу «Все акции»;
>   - Инструменты с типом STYLE=BOND – в группу «Все облигации».
>
>   Если в описании инструмента указан параметр SECTYPE=<Код предопределенной группы>, то загружаемый инструмент включается в состав указанной предопределенной группы инструментов.

В группу инструментов можно включать предопределенные группы и группы, уже созданные пользователем ранее. Таким образом, одна группа может быть подгруппой другой группы инструментов.

3.2 Таблица «Группы инструментов»

меню **Расширения / TrustManager / Группы инструментов…**

Таблица предназначена для просмотра групп инструментов.



Каждая группа инструментов описывается отдельной строкой таблицы. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код группы	Код группы инструментов
Описание группы	Описание группы инструментов
Свойства	Свойства группы инструментов. Возможные значения: _ «Р» – рейтинг. Группа инструментов, основанная на рейтинге; _ «П» – пересечение. Группа инструментов в режиме «пересечения» означает, что инструмент входит в эту группу тогда и только тогда, когда он входит в каждый из элементов этой группы Для всех других групп инструментов поле не заполняется
Члены группы	Список инструментов и целых классов инструментов, включенных в группу, через запятую. У инструментов в скобках указан класс инструмента. Классы, добавленные в виде исключения, указаны с приставкой «не». Для предопределенных групп инструментов содержимое не указывается (пусто)

3.2.1 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

3.2.2 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

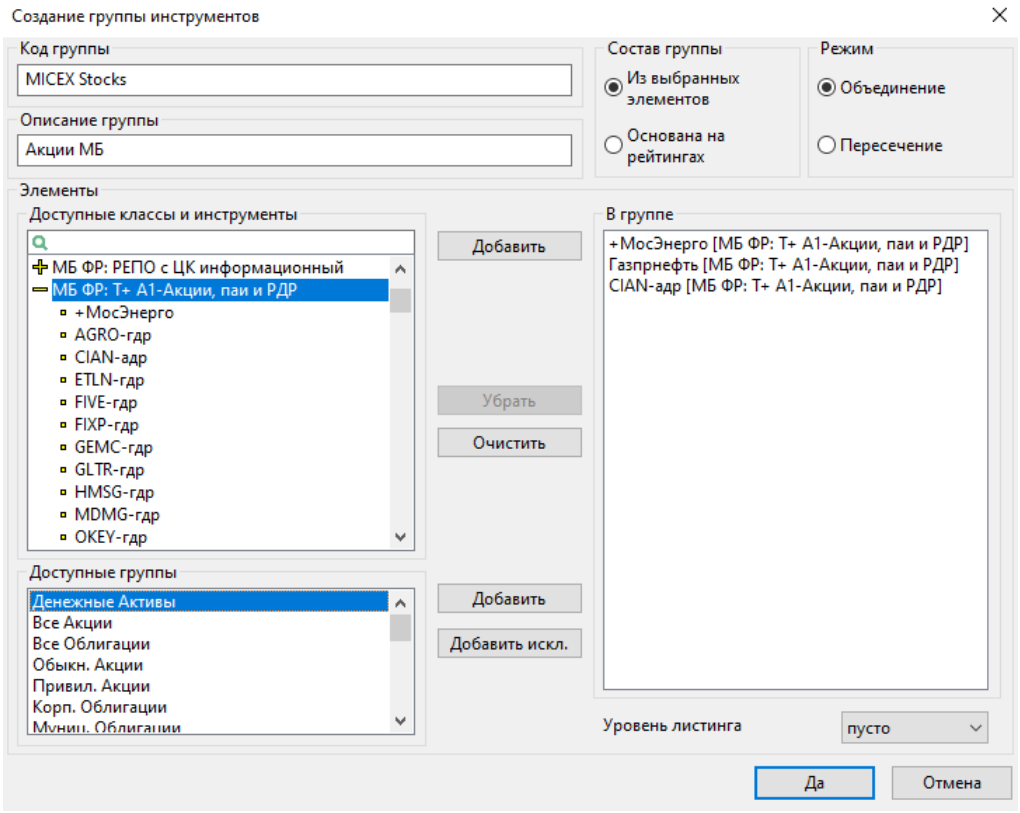
- «Состав группы инструментов» – открыть таблицу «Состав группы инструментов <код группы>»;
- «Добавить группу инструментов» – создать группу инструментов;
- «Изменить группу инструментов» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – редактировать выбранную группу инструментов;
- «Удалить группу инструментов» – удалить выбранную группу инструментов.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

3.3 Действия с группами инструментов

3.3.1 Создание группы инструментов

Группа инструментов создается из таблицы «Группы инструментов», выбором пункта контекстного меню «Добавить группу инструментов». На экране появится окно со следующими параметрами:



1. «Код группы» – сокращенное наименование группы инструментов для использования в ограничениях.
2. «Описание группы» – расширенное наименование группы (используется как пояснение).
3. «Элементы»:

   — «Доступные классы и инструменты» – список доступных инструментов, сгруппированных по классам. Вверху списка доступно поле для быстрого поиска, записи в списке фильтруются по вводимой подстроке.

Для предотвращения циклических ссылок, группы инструментов в состав которых входит редактируемая группа, недоступны для добавления в её состав. Удаление группы инструментов, которая входит как составная часть в другую группу инструментов, невозможно.

- «Доступные группы» – список доступных предопределенных групп, а также групп инструментов, уже созданных пользователем.

  Добавление группы инструментов из списка в новую группу выполняется нажатием кнопок:

  - «Добавить» – добавить выбранную группу из списка;
  - «Добавить искл.» – добавить в новую группу все инструменты, кроме включенных в выбранную группу. Исключения отображаются в списке «В группе» с приставкой «не».

- «В группе» – список инструментов, включенных в группу.

  Чтобы убрать из списка «В группе» какой-либо класс либо инструмент, нажмите кнопку «Удалить». Нажатием кнопки «Очистить» сбрасываются все выбранные инструменты и классы.

- «Уровень листинга» – выбор уровня листинга для группы инструментов. Уровень листинга инструмента определяется значением одноименного параметра в Таблице текущих торгов. Возможные значения:
  - <пусто> (по умолчанию) – уровень листинга не учитывается;
  - «0» – в Таблице текущих торгов данный параметр отсутствует;
  - «1» / «2» / «3» – уровень листинга из Таблицы текущих торгов.

> **Если уровень листинга инструмента не равен уровню листинга, заданному для группы инструментов, то такой инструмент не считается включенным в данную группу инструментов.**

4. «Состав группы» – выбор состава группы:
   - «Из выбранных элементов»;
   - «Основана на рейтингах» (рейтинги инструментов могут быть загружены из текстового файла, подробнее в п. Рейтинговые агентства).
5. «Режим» – выбор режима группы инструментов. Возможные значения:
   - «Объединение» (по умолчанию) – инструмент принадлежит группе, если он принадлежит хотя бы одной группе из перечисленных в поле «В группе»;
   - «Пересечение» – инструмент принадлежит группе, если инструмент принадлежит каждой группе из перечисленных в поле «В группе».

Создание группы завершается нажатием кнопки «Да». Новая группа отобразится в таблице «Группы инструментов».

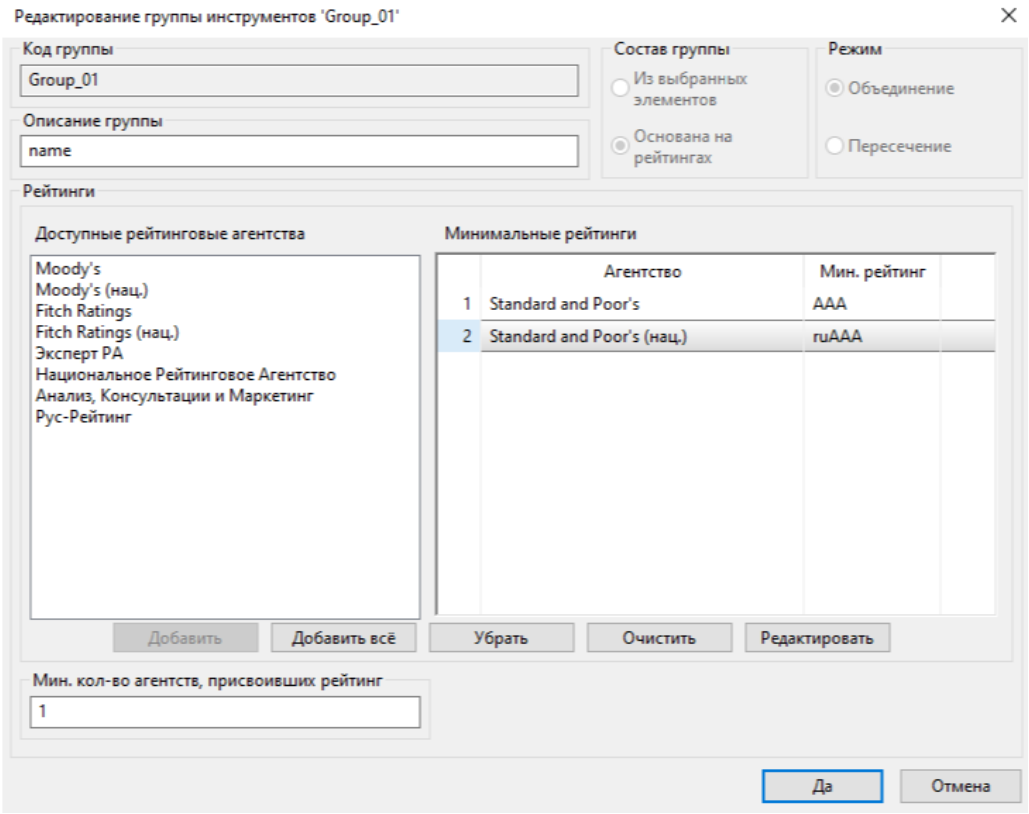
3.3.2 Редактирование группы инструментов

Созданную ранее группу можно редактировать – добавлять и удалять входящие в нее инструменты. Значение поля «Код группы» изменению не подлежит.

Для изменения группы выделите соответствующую ей строку в таблице «Группы инструментов» и выберите пункт контекстного меню «Изменить группу инструментов».

> **Изменение состава группы может привести к нарушению ранее установленных ограничений (подробнее см. п. Ограничения).**

При редактировании групп инструментов, основанных на рейтингах, на форме доступны следующие поля:



1. «Описание группы» – ввод описания группы инструментов.
2. «Рейтинги»:

   - «Доступные рейтинговые агентства» – список наименований загруженных рейтинговых агентств.

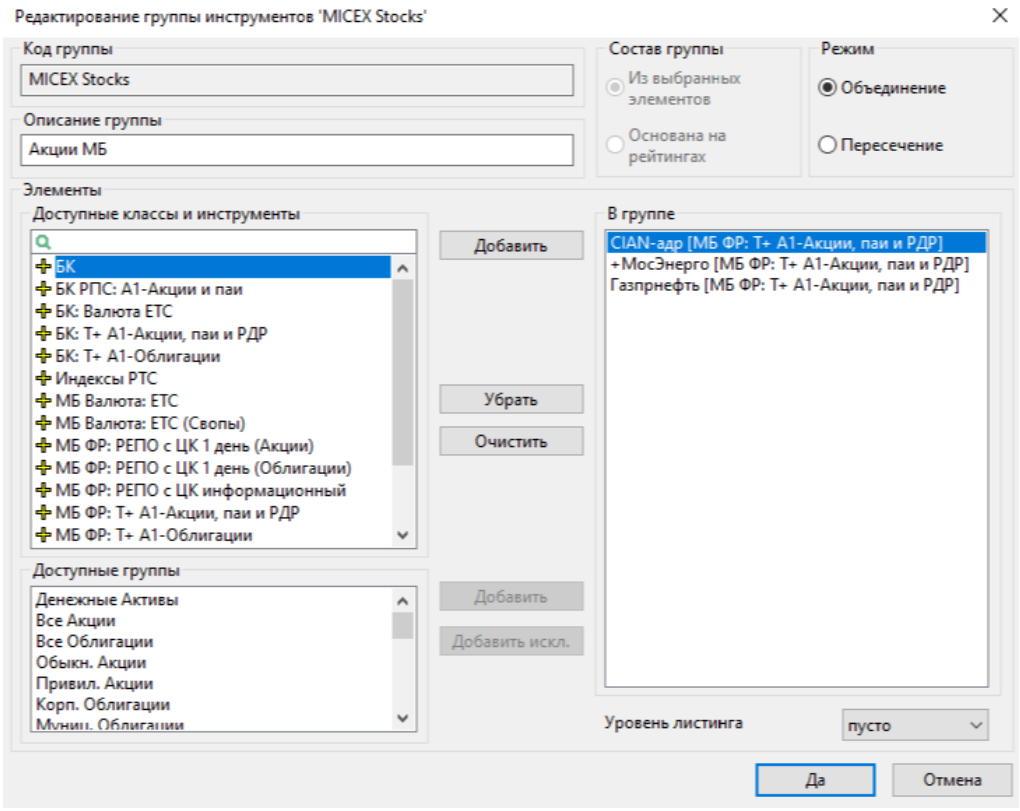
     Если у агентства имеются как международный, так и национальный рейтинги, то такое агентство отображается в таблице дважды:

     - наименование агентства с международным рейтингом;
     - наименование агентства с добавлением в конце строки «нац.» с национальным рейтингом.

   - «Мин. кол-во агентств, присвоивших рейтинг» – ввод минимального количества агентств, присвоивших рейтинг, не превышающего общее число доступных рейтинговых агентств. По умолчанию: «1».
   - Таблица «Минимальные рейтинги» – таблица для редактирования минимальных рейтингов. Имеет две колонки:
     - «Агентство» – наименование агентства;

- «Мин. рейтинг» – выбор из списка рейтинга, доступного для данного агентства, упорядоченного по убыванию.

При редактировании прочих групп инструментов, на форме доступны поля:



1. «Описание группы» – описание группы инструментов.
2. «Элементы»:
   - «Доступные классы и инструменты» – список доступных инструментов, сгруппированных по классам,
   - «Доступные группы» – список доступных предопределенных групп, а также групп инструментов, уже созданных пользователем.
   - «В группе» – изменение состава инструментов в группе.
   - Уровень листинга» – уровень листинга для группы инструментов. Уровень листинга инструмента определяется значением одноименного параметра в Таблице текущих торгов. Возможные значения:
     - <пусто> (по умолчанию) – уровень листинга не учитывается;
     - «0» – в Таблице текущих торгов данный параметр отсутствует;
     - «1» / «2» / «3» – уровень листинга из Таблицы текущих торгов.
3. «Режим» – режим группы инструментов. Возможные значения:
   - «Объединение» (по умолчанию) – инструмент принадлежит группе, если он принадлежит хотя бы одной группе из перечисленных в поле «В группе».
   - «Пересечение» – инструмент принадлежит группе, если инструмент принадлежит каждой группе из перечисленных в поле «В группе».

3.3.3 Удаление группы инструментов

Для удаления группы выделите соответствующую ей строку в таблице «Группы инструментов» и выберите пункт контекстного меню «Удалить группу инструментов».

> **Удаление группы приводит к удалению всех ограничений с использованием данной группы.**

3.3.4 Удаление групп инструментов

Для удаления всех групп инструментов выберите пункт меню **Расширения / TrustManager / Удаление групп инструментов...**.

В открывшемся окне задайте условия:

1. «Удалить все группы инструментов» – по умолчанию флажок установлен и при этом прочие фильтры недоступны.
2. «Режим» – выбор режима из выпадающего списка, по которому будут удалены группы инструментов. Возможные значения:
   - «Объединение»;
   - «Пересечение».

   Если установлен флажок «Все режимы», то выбор режимов недоступен.
3. «Состав группы» – выбор состава группы из выпадающего списка, по которому будут удалены группы инструментов. Возможные значения:
   - «Из выбранных элементов»;
   - «Основана на рейтингах».

   Если установлен флажок «Все», то выбор состава группы недоступен.

При нажатии на кнопку «Удалить» происходит удаление всех групп инструментов, удовлетворяющих заданным условиям.

Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без удаления групп инструментов.

3.4 Управление группами инструментов из внешних приложений

Существует два способа управления группами инструментов из внешних приложений:

- с помощью текстового файла;
- с помощью хранимых процедур.

3.4.1 Импорт групп инструментов при старте программы

Группы инструментов могут быть импортированы при старте программы. Настройка «Загружать при запуске описания групп инструментов» (меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Импорт данных») позволяет использовать текстовый файл для создания, изменения или удаления групп инструментов. Формат файла описан в п. 10.1.

3.4.2 Изменение групп инструментов с помощью хранимых процедур

Добавлять, удалять, а также изменять группы инструментов возможно без перезапуска программы с помощью хранимых процедур. Описания процедур с примерами использования приведены в п. 12.

4. Состав группы инструментов

4.1.1 Назначение

Таблица предназначена для отображения содержимого выбранной группы инструментов и открывается из контекстного меню таблицы «Группы инструментов» выбором пункта контекстного меню «Состав группы инструментов».

4.1.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному инструменту. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код класса	Код класса инструмента
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе
Инструмент сокр.	Сокращенное наименование инструмента
Инструмент	Наименование инструмента
ISIN	ISIN-код инструмента
Тип	Тип инструмента

4.1.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

4.1.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

5. Ограничения

Ограничения предназначены для автоматического контроля доли определенной группы активов в портфеле клиента. Для работы с ограничениями нужно сначала сформировать группу инструментов, а затем установить контролируемое ограничение.

Ограничение представляет собой условие, при котором стоимость активов, входящих в указанную группу инструментов G_1, должна быть не больше (или не меньше) суммарной стоимости активов клиента (или некоторой другой группы инструментов G_2, не обязательно являющейся надмножеством G_1), либо запрет на торговлю данной группой инструментов.

Ограничение может задаваться как на отдельного клиента, так и на группу клиентов:

- **Ограничение на клиента** означает условие, которое должно выполняться применительно к активам определенного клиента.
- **Ограничение на группу (индивидуально)** означает условие, которое должно выполняться для каждого из клиентов, входящего в данную группу клиентов.
- **Ограничение на группу (суммарно)** означает условие, которое должно выполняться для суммарных активов всей группы клиентов.

Ограничения являются дополнительными условиями при вводе групповой заявки, применяемыми таким образом, что результат исполнения групповой заявки не должен привести к нарушению ограничений на структуру клиентского портфеля. Проверка заявок на соответствие ограничений включена по умолчанию и может быть отключена снятием флажка «Исп-ть ограничения» в окне ввода заявки.

Помимо проверки условий ограничений при вводе заявок, TrustManager производит периодическую переоценку активов клиента. Если изменившаяся стоимость активов перестала соответствовать установленным ограничениям, программа выдает предупреждение в специальном окне «Нарушения ограничений».

Настройки программы, относящиеся к работе с ограничениями, находятся в пункте меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, на вкладке «Ограничения».

> **ВАЖНО!**
> 1. **При подаче заявки через Рабочее место QUIK любым доступным способом (через форму ввода новой заявки, «Карман транзакций», импорт транзакций через API и текстовый файл, с помощью алгоритмического языка QPILE) осуществляется проверка выполнения ограничений, заданных в TrustManager. При подаче заявки, приводящей к нарушению ограничения,**

заявка отвергается системой и на экран выводится соответствующее предупреждение.

2. **Чтобы отключить проверку заявок, подаваемых через Рабочее место QUIK, необходимо в программе QUIK Administrator в окне «Клиентские модули» включить для пользователя опцию «Отключить проверку заявок на выполнение ограничений TrustManager».**

5.1 Таблица «Ограничения по клиентам»

меню **Расширения / TrustManager / Ограничения по клиентам...**

5.1.1 Назначение

Таблица предназначена для просмотра ограничений, установленных на величину стоимости активов клиентов.

5.1.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному ограничению. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Код группы инструментов	Код группы инструментов
Группа инструментов	Описание группы инструментов. Для ограничений типа «инструменты любого эмитента» отображается строка: «Любой эмитент» или «Любой эмитент из <Группа инструментов>»
Тип	Направление ограничения: «не более» заданной величины лимита, «не менее» заданной величины лимита либо «не изменять» величину.
Лимит	Значение ограничения, выраженное в единицах измерения, указанных в поле «Единица изм.»
Текущее значение	_ Текущая доля группы активов клиента (если единица измерения указана в процентах), на которую накладывается ограничение, в общей стоимости активов (портфеля либо группы инструментов) либо _ Текущее значение стоимости группы активов клиента (если единица измерения – «руб»)
Единица изм.	Единица измерения ограничения: «%» – в относительном выражении, «руб» – в абсолютном выражении, «шт» – в штуках
Ограничение к	Наименование группы инструментов либо клиентский портфель, относительно которых определяется ограничение

Заголовок	Назначение
Свойства	Отображение свойства ограничения, код из нескольких символов. Возможные значения: – «Н» – для данного ограничения не используется НКД в расчётах; – «В» – для объёма обращения используется суммирование по выпускам одного инструмента
Активно	Отключение ограничения
Идентификатор	Ключ для экспорта по ODBC
Срок расчётов	Срок расчетов
Код ограничения	Уникальный код ограничения
Наименование ограничения	Наименование ограничения

5.1.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Фильтр клиентов» – фильтр кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента».
4. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.

5.1.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Добавить ограничение» – создать ограничение.
- «Редактировать ограничение» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – изменить выбранное ограничение.
- «Удалить ограничение» – удалить выбранное ограничение.
- «Экспорт ограничений» – открытие диалога экспорта ограничений.
- «Выполнение ограничения» – открыть таблицу «Выполнение условий ограничения <Код ограничения>» для просмотра детальной информации по выполнению условий выбранного ограничения. Функция недоступна для ограничений типа «Ограничение на торговлю».
- «Информация по ограничению» – открыть таблицу «Список ограничений» для просмотра ограничений, настроенных для выбранного клиента. Функция недоступна для ограничений типа «На группу (суммарно)».

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

5.2 Таблица «Ограничения по группам клиентов»

меню **Расширения / TrustManager / Ограничения по группам клиентов…**

5.2.1 Назначение

Таблица предназначена для просмотра ограничений, установленных на стоимость активов группы клиентов.

5.2.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному ограничению. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код группы клиентов	Код группы
Код группы инструментов	Код группы инструментов
Группа инструментов	Описание группы инструментов
Тип	Направление ограничения: «не более» заданной величины лимита, «не менее» заданной величины лимита, либо «не изменять» величину.
Лимит	Значение ограничения, выраженное в единицах измерения, указанных в поле «Единица изм.»
* Текущее значение	– Текущая доля группы активов клиентов (если единица измерения указана в процентах), на которую накладывается ограничение, в общей стоимости активов (портфеля либо группы инструментов) либо – Текущее значение стоимости группы активов клиентов (если единица измерения – «руб»)
Единица изм.	Единица измерения ограничения: «%» – в относительном выражении, «руб» – в абсолютном выражении
Ограничение к	Наименование группы инструментов либо клиентский портфель, относительно которых определяется доля
Свойства	Отображение свойства ограничения, код из нескольких символов. Возможные значения: – «С» – ограничение на группу (суммарно); – «Н» – для данного ограничения не используется НКД в расчётах; – «В» – для объёма обращения используется суммирование по выпускам одного инструмента
Активно	Отключение ограничения
Идентификатор	Ключ для экспорта по ODBC
Срок расчётов	Срок расчетов

Заголовок	Назначение
Код ограничения	Уникальный код ограничения
Наименование ограничения	Наименование ограничения

* – если при выставлении групповой заявки установлен признак «Повысить (Понизить) долю до … %», то значение параметра вычисляется по следующему алгоритму:

- вычисляется текущее значение выбранного актива для каждого клиента, входящего в выбранную группу клиентов;
- из полученных значений выбирается наименьшее значение при заявке на покупку или наибольшее при заявке на продажу.

5.2.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.

5.2.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Добавить ограничение» – создать ограничение.
- «Редактировать ограничение» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – изменить выбранное ограничение.
- «Удалить ограничение» – удалить выбранное ограничение.
- «Экспорт ограничений» – открытие диалога экспорта ограничений.
- «Выполнение ограничения» – открыть таблицу «Выполнение условий ограничения <Код ограничения>» для просмотра детальной информации по выполнению условий выбранного ограничения. Функция недоступна для ограничений типа «Ограничение на торговлю».
- «Информация по ограничению» – открыть таблицу «Список ограничений» для просмотра ограничений по клиентам, входящим в выбранную группу. Функция недоступна для ограничений типа «На группу (суммарно)».

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

5.3 Таблица «Список ограничений»

меню **Расширения / TrustManager / Информация по ограничениям…**

5.3.1 Назначение

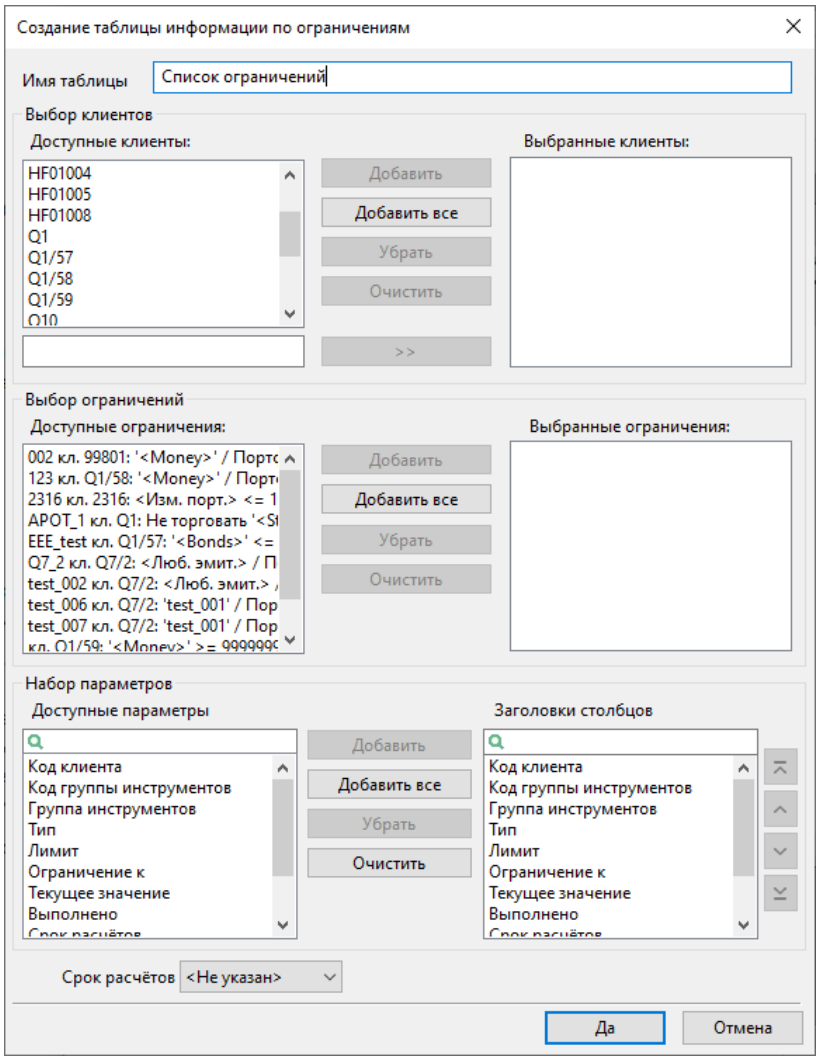
Таблица предназначена для просмотра текущего состояния установленных ограничений.

5.3.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному ограничению по отдельному коду клиента. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код клиента	Код клиента
Код группы инструментов	Код группы инструментов
Группа инструментов	Описание группы инструментов
Тип	Направление ограничения: «не более» заданной величины лимита, «не менее» заданной величины лимита, либо «не изменять» величину
Лимит	Значение лимита, в процентах
Ограничение к	Указывает относительно чего наложены ограничения (портфеля либо группы инструментов)
Текущее значение	Текущая доля группы активов клиентов, на которую накладывается ограничение, в общей стоимости активов.
Выполнено	Статус выполнения ограничения. Возможные значения: «выполнено» или «не выполнено».
Срок расчётов	Срок расчетов
Код ограничения	Уникальный код ограничения
Наименование ограничения	Наименование ограничения

5.3.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Выбор клиентов» – настройка кодов клиентов, отображаемых в таблице, путем формирования списка «Выбранные клиенты». В списке «Доступные клиенты» отображен полный список возможных кодов. Если искомый код отсутствует в списке, его можно ввести вручную в поле ниже списка, и затем нажать кнопку «>>». В таблице отображаются данные по всем ограничениям, затрагивающим выбранного клиента, кроме ограничений типа «На группу (суммарно)».
3. «Выбор ограничений» – настройка ограничений для показа в таблице, путем формирования списка «Выбранные ограничения». В списке «Доступные ограничения» перечислены все настроенные ограничения, кроме ограничений типа «На группу (суммарно)».
4. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
5. «Срок расчётов» – настройка фильтра для отображения данных в таблице по выбранному сроку расчета.

5.3.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

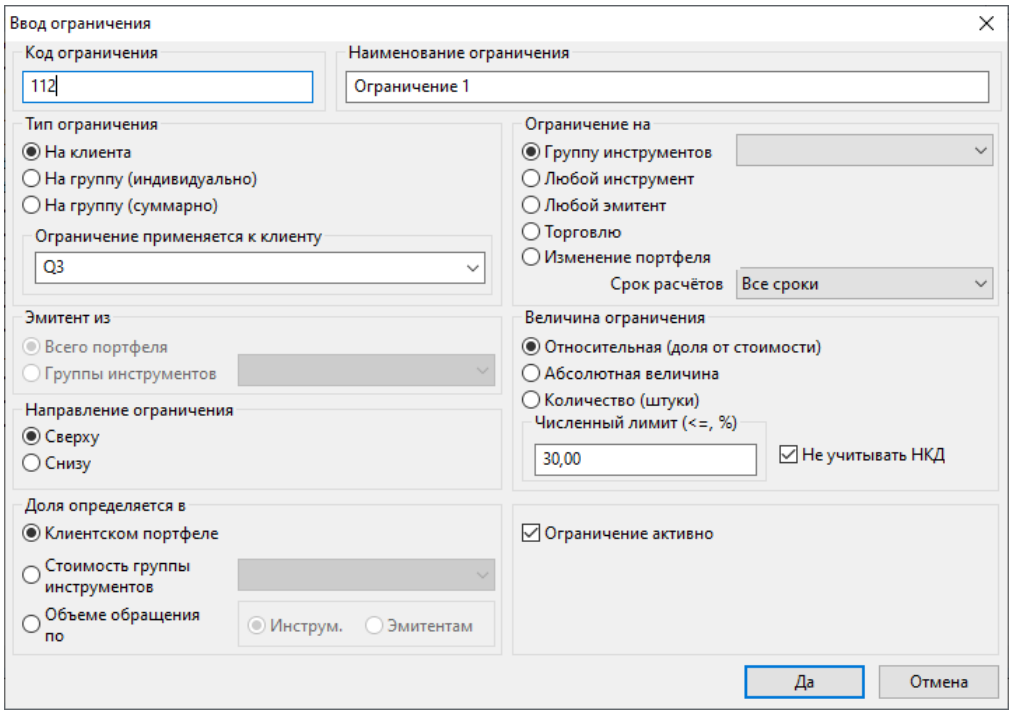
Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

5.4 Действия с ограничениями

5.4.1 Создание ограничения

Новое ограничение можно создать, выбрав пункт контекстного меню «Добавить ограничение» в таблице «Ограничения по клиентам» либо в таблице «Ограничения по группам клиентов».

В открывшемся окне заполните поля:



1. «Код ограничения» – уникальный код ограничения.
2. «Наименование ограничения» – наименование ограничения.
3. «Тип ограничения» – выбор типа ограничения: на клиента, на группу клиентов (индивидуально) или на группу клиентов (суммарно).
4. «Ограничение применяется к клиенту» / «… к группе» – выбор из списка кода клиента либо группы, на который накладывается ограничение.
5. «Ограничение на»:

   - «Группу инструментов» – ограничение накладывается на группу инструментов, указанную в поле «Ограничение по группе инструментов».
   - «Любой инструмент» – ограничение накладывается на стоимость отдельного инструмента, входящего в портфель клиента или группы клиентов, либо входящего в указанную группу инструментов (см. параметр «Инструмент из»). В поле «Численный лимит» указывается предельное значение процента от портфеля клиента или группы клиентов, в котором допускается хранить один актив.

- «Любой эмитент» – ограничение накладывается на стоимость всех инструментов эмитента, входящего в портфель клиента или группы клиентов, либо на стоимость всех инструментов эмитента, входящего в указанную группу инструментов (см. параметр «Эмитент из»). В поле «Численный лимит» указывается предельное значение процента от портфеля клиента или группы клиентов, в котором допускается хранить инструменты эмитента. Принадлежность к тому или иному эмитенту определяется по номеру государственной регистрации.
- «Торговлю» – операции по данной группе инструментов недоступны клиенту/группе клиентов.
- «Изменение портфеля» – ограничение накладывается на **величину отклонения стоимости текущего портфеля**[*] клиента от стоимости эталонного портфеля. Предельная величина отклонения указывается в виде абсолютной величины (в рублях) или в процентах от стоимости эталонного портфеля (при этом эталонный портфель оценивается по текущим ценам). Направление ограничения устанавливается только «сверху».

Для ограничений на «Группу инструментов» и на «Любой инструмент» предусмотрена настройка «Не учитывать НКД». [**]

6. «Срок расчётов» – настройка фильтра по выбранному сроку расчетов, к которому применяется ограничение.
7. «Ограничение по группе инструментов» – группа инструментов, контролируемая ограничением.
8. «Инструмент из» – параметр для ограничения «на любой инструмент»:
9. «Всего портфеля» – ограничение применяется к любому инструменту, входящему в портфель клиента (либо группы клиентов).
10. «Группы инструментов» – ограничение применяется к инструменту, входящему в группу инструментов, выбранному из списка «Ограничение по группе инструментов».
11. «Эмитент из» – параметр для ограничения «на любой эмитент»:

- «Всего портфеля» – ограничение применяется к любым инструментам эмитента, входящего в портфель клиента (либо группы клиентов);
- «Группы инструментов» – ограничение применяется к инструментам эмитента, входящего в группу инструментов, выбранного из списка «Ограничение по группе инструментов».

12. «Величина ограничения» – способ указания ограничения:

- «Относительная (доля от стоимости)» – ограничение задается в процентах от стоимости активов.
- «Абсолютная величина» – ограничение задается в виде абсолютной величины стоимости позиции по группе инструментов в денежном выражении.
- «Количество (штуки)» – ограничение задается в штуках.

13. «Направление ограничения»:

- «сверху» – отношение стоимости группы инструментов к стоимости активов с учетом денежных средств, определенных параметром «Доля определяется в», не должно превышать заданную величину в процентах;
- «снизу» – доля стоимости группы инструментов в суммарной стоимости активов без учета стоимости денежных средств должна быть не ниже определенной величины.

14. «Численный лимит» – величина ограничения. В скобках указано направление проверки ограничения, и единица исчисления («%» – в процентах). Для запрета на покупку активов при сохранении возможности продавать допускаются ограничения типа «не более 0», «не более 0%», только если установлено направление ограничения – «Сверху».
15. «Доля определяется в» – показатель, относительно которого рассчитывается доля стоимости актива:

    - «Клиентском портфеле» – в стоимости активов, содержащихся в портфеле,
    - «Стоимости группы инструментов» – в стоимости группы инструментов, выбранной из выпадающего списка,
    - «Объеме обращения по» – в совокупном объеме обращения инструментов либо эмитентов, входящих в группу, по которой устанавливается ограничение. Параметр доступен, если выбрано ограничение «на группу инструментов».

> **Параметр «Объем обращения» транслируется только торговой системой Московской биржи.**

> **Вариант расчета ограничения устанавливается в настройках модуля, в пункте меню Расширения / TrustManager / Настройки..., вкладка «Ограничения», флажок «Для ограничений снизу на долю в портфеле брать только стоимость инструментов в качестве оценки портфеля».**
> **Предусмотрено два варианта расчета ограничений «снизу» с определением доли в портфеле:**
> 1. **Доля стоимости актива определяется в стоимости всех инструментов (опция включена),**
> 2. **Доля стоимости актива определяется в стоимости портфеля с учётом денежного остатка (опция отключена).**

Если созданное ограничение сразу не выполняется (нарушается текущей структурой активов клиента либо группы), то перед сохранением ограничения программа выдаст соответствующее предупреждение.

Новое ограничение по клиентам отобразится в таблице «Ограничения по клиентам», ограничение по группам – в таблице «Ограничения по группам клиентов».

> **После создания ограничения на торговлю по группе инструментов в формах ввода заявок для инструментов из этой группы проставляется нулевой доступный объём заявки, что делает невозможными торговые операции. Но закрытие коротких позиций и закрытие позиций на срочном рынке по инструментам, входящим в выбранную группу, остается возможным.**
> **(*) Расчет величины отклонения стоимости текущего портфеля:**
> Пусть у некоторого клиента **c** имеется портфель **P(c)**, состоящий из текущих позиций по деньгам $\mathbf{m_i^c}$ и бумагам $\mathbf{d_j^c}$ (по инструменту I_j^c). Пусть для этого клиента задан также эталонный портфель $\mathbf{P_0(c)}$, состоящий из позиций по деньгам $\mathbf{m_i^{c0}}$ и бумагам $\mathbf{d_j^{c0}}$ (по инструменту I_j^c). Если эталонный портфель для клиента **c** не задан, то считается,

что эталонный портфель совпадает с позициями клиента на начало дня (то есть с начальной позицией по деньгам и бумагам). Пусть для инструмента **I** позиция оценивается по цене **p(I)**, где тип цены (спрос, предложение, последняя сделка или другие варианты) зависит от соответствующих настроек. Если имеется несколько позиций одного и того же инструмента по нескольким торговым счетам, то в целях расчёта отклонения портфеля от эталонного, позиции по данному инструменту по всем торговым счетам суммируются. Тогда отклонением портфеля клиента **c** от эталонного значения будет величина:

$$Div(P(c),\ P_0(c)) = \left| \sum_i Neg\left(m_i^c - m_i^{c0}\right) + \sum_j Neg\left(d_j^c - d_j^{c0}\right) \cdot p\left(I_j^c\right) \right|$$

(**): Если инструмент – облигация, то цена пересчитывается из процентов в базовую валюту по формуле: Цена*Номинал/100+НКД. При включенной настройке «Не учитывать НКД» для данного ограничения в зависимости от типа расчёта учитывается различная цена:

1. **Стоимость портфеля (как суммы денежных позиций и суммы оценки позиций по инструментам) рассчитывается по формуле: Цена*Номинал/100+НКД.**
2. **Стоимость группы инструментов рассчитывается по формуле: Цена*Номинал/100.**

(***): При расчете стоимости портфеля и проверке ограничений для инструментов с сопряженной валютой:

1. **Для акций используется сопряженная валюта.**
2. **Для облигаций цена пересчитывается по формуле: Цена/100*Номинал*(кросс-курс из базовой валюты в сопряженную валюту) + НКД.**

5.4.2 Редактирование ограничения

Чтобы изменить существующее ограничение, выделите соответствующую строку в таблице, а затем выберите пункт контекстного меню «Редактировать ограничение» либо дважды нажмите левую кнопку мыши.

В созданном ограничении можно изменять наименование ограничения, срок расчётов и величину численного лимита по ограничению.

Если отсутствует значение в поле «Код ограничения», то при редактировании данное поле доступно для заполнения.

В нижней части формы редактирования ограничения отображается краткая запись условия ограничения в формате:

```
(<Субъект>): <Условие>
```

Где <Субъект> ограничения отображается в виде:

- «кл. <Код клиента>» – для ограничений, заданных на клиентов;
- «гр. <Код группы клиентов> [индивид.]» – для ограничений на группу, заданных на индивидуальные активы клиентов;
- «гр. <Код группы клиентов> [суммарно]» для ограничений на группу, заданных на сумму активов клиентов.

Например, при редактировании ограничения по клиенту Q1, условие отображается в виде:

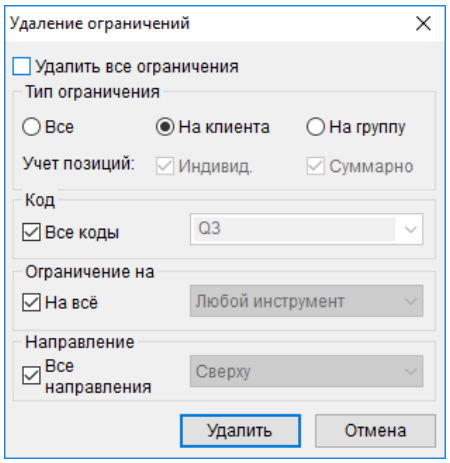
```
кл.Q1: 'MSNG02' >=12 шт.
```

5.4.3 Удаление ограничения

Чтобы удалить существующее ограничение, выделите соответствующую строку в таблице и выберите пункт контекстного меню «Удалить ограничение».

5.4.4 Удаление всех ограничений

Для удаления всех ограничений выберите пункт меню **Расширения / TrustManager / Удаление ограничений….**



В открывшемся окне задайте условия:

1. «Удалить все ограничения» – по умолчанию флажок установлен и при этом прочие фильтры недоступны.
2. «Тип ограничения» – тип, по которому будут удалены все ограничения. Возможные значения:
    - «Все» – при установленном флажке «Все», выбор другого типа ограничения недоступен;
    - «На клиента»;
    - «На группу».

3. «Учет позиций» – доступен, если выбран тип ограничения «На группу». Возможные значения:
    - «Индивид.» – ограничение на группу индивидуально;
    - «Суммарно» – ограничение на группу суммарно.
4. «Код» – код клиента, по которому будут удалены все ограничения. Выбор кода доступен, если в «Тип ограничения» выбран тип «по клиенту» или «по группе клиентов». Если установлен флажок «Все коды», то выбор кода клиента недоступен.
5. «Ограничения на» – вид ограничения. Возможные значения:
    - «Группу инструментов»;
    - «Любой инструмент»;
    - «Любой эмитент»;
    - «Торговлю»;
    - «Изменение портфеля».

    При установленном флажке «на всё» выбор вида ограничения недоступен.
6. «Направление» – направление ограничения. Возможные значения:
    - «сверху»;
    - «снизу».

    При установленном флажке «Все направления» выбор направления недоступен.

При нажатии на кнопку «Удалить» происходит удаление всех ограничений, удовлетворяющих заданным условиям. Если в поле «Учет позиций» не выбрано ни одно значение, то на экран выводится предупреждение вида: «Не указано значение в поле «Учёт позиций».

Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без удаления ограничений.

5.5 Управление ограничениями из внешних приложений

Существует два способа управления ограничениями из внешних приложений:

- с помощью текстового файла;
- с помощью хранимых процедур.

5.5.1 Загрузка ограничений из внешнего файла

Импорт ограничений из файла позволяет как добавлять новые ограничения, так и удалять имеющиеся.

1. Откройте пункт меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, выберите вкладку «Ограничения».
2. Включите флажок «Загружать при запуске описания ограничений из файла».
3. Нажмите кнопку «Выбрать» и укажите путь к файлу с ограничениями.

Файл загружается при запуске Рабочего места QUIK. Формат файла описан в п. 10.5.

При нажатии на кнопку «Загрузить сейчас» произойдет загрузка указанного файла вручную.

5.5.2 Изменение ограничений с помощью хранимых процедур

Добавлять, удалять, а также изменять ограничения возможно без перезапуска программы с помощью хранимых процедур. Описания процедур с примерами использования приведены в п. 12.

5.6 Таблица «Выполнение условий ограничения»

Таблица «Выполнение условий ограничения» открывается выбором пункта контекстного меню «Выполнение ограничения» в таблице «Ограничения по клиентам» либо в таблице «Ограничения по группам клиентов».

5.6.1 Назначение

Таблица предназначена для просмотра детальной информации по выполнению условий выбранного ограничения.

5.6.2 Формат таблицы

Если ограничение задано на клиента, то в таблице отображается информация только по этому клиенту (как одна или несколько строк).

Если ограничение задано на группу клиентов (индивидуально), то каждая строка в таблице соответствует отдельному клиенту из этой группы. Если ограничение задано на группу клиентов (суммарно), то в таблице отображается суммарная информация по этой группе клиентов.

В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Код клиента	Код клиента. Для ограничений на суммарные активы группы клиентов отображается Код группы
Срок расчётов	Срок расчетов
Код группы инструментов	Код группы инструментов. Только для ограничений на «Группу инструментов»
Группа инструментов	Описание группы инструментов. Только для ограничений на «Группу инструментов»
Код инструмента	Код инструмента. Только для ограничений на «Любой инструмент»

Заголовок	Назначение
Инструмент	Наименование инструмента. Только для ограничений на «Любой инструмент»
Эмитент	Код эмитента. Только для ограничений на «Любой эмитент»
Портфель	Значение: «Портфель». Только для ограничений на отклонение портфеля от эталонного
Объект	В зависимости от типа ограничения заполняется одним из значений колонок «Группа инструментов», «Инструмент», «Эмитент», «Портфель»
Текущее значение	Текущее значение, контролируемое ограничением: _ Доля стоимости; _ Стоимость; _ Количество; _ Величина отклонения портфеля
Тип	Условие ограничения. Возможные значения: _ «не более»; _ «не менее»
Лимит	Предельная величина, заданная в ограничении
Выполнено	Отображение выполнения ограничения. Возможные значения: _ «Да» – условие ограничения для данной строки выполнено; _ <Пусто> – не выполнено

При удалении ограничения таблица «Выполнение условий ограничения» автоматически очищается.

6. Торговые операции

6.1 Операции с групповыми заявками

Операции с групповыми заявками являются ключевой функцией программы TrustManager.

Назначение **групповой заявки** заключается в одновременном вводе нескольких однотипных заявок по одному и тому же инструменту по разным счетам клиентов, включенных в одну группу.

В групповой заявке указывается общий объем заявок для всей группы клиентов, который затем автоматически разделяется на несколько индивидуальных заявок. Для обычных групп клиентов объем групповой заявки разделяется между членами группы пропорционально доле активов каждого клиента в активах группы. Пропорции формируются автоматически по заданным правилам, при этом учитываются заданные в Рабочем месте QUIK ограничения на минимальный объем заявки (см. п. 13.2), и если у клиента недостаточный объем средств,

то он исключается из групповой заявки, а объем исключенных заявок распределяется между заявками остальных клиентов (для айсберг-заявок данные ограничения не учитываются). Перед выставлением заявки в торговую систему пропорции могут редактироваться и вручную. Таким образом, имеется возможность для групп клиентов с фиксированными долями самостоятельно задавать весовые коэффициенты, в соответствии с которыми будет производиться разделение объема заявок.

Предусмотрена возможность просмотра и ручной корректировки объемов индивидуальных заявок перед их отправкой в торговую систему.

Сформированный пакет заявок передается в торговую систему биржи и обрабатывается как набор стандартных биржевых заявок. Результат обработки отображается в виде изменения состояния групповой заявки и включенных в нее индивидуальных заявок.

Если одна или несколько индивидуальных заявок были отвергнуты сервером QUIK либо торговой системой, то ввод заявок может быть прекращен и введенные ранее заявки будут отозваны из торговой системы (определяется настройками).

Групповая заявка обладает набором дополнительных условий:

1. «Разбиение количества по заявкам клиентов» – алгоритм разделения объема групповой заявки по индивидуальным:

   - «Округление долей вниз (к нулю)» – объем каждой заявки округляется вниз до целого значения.

     Пример:

     В составе группы имеется три клиента с количеством бумаг Русгидро, доступным на момент подачи заявки в размере 5, 7, 90 лотов

     При вводе групповой заявки по этой группе клиентов на продажу 15 лотов Русгидро по этим клиентам будут поданы заявки на продажу 15 * 5/102 (округляется до 0), 15 * 7/102 (округляется до 1), 15 * 90/102 (округляется до 13) лотов соответственно.

   - «Округление долей с сохранением суммарного количества» – объем каждой заявки округляется либо вверх, либо вниз до ближайшего целого значения таким образом, чтобы суммарный объем заявок был равен объему групповой заявки.

2. «Повысить/Понизить до..» – увеличение (для заявки на покупку) либо уменьшение (для заявки на продажу) доли инструмента в стоимости активов группы. Для заявки с таким условием вычисляется требуемый объем групповой заявки, затем осуществляется ее разделение по индивидуальным заявкам в соответствии с выбранным алгоритмом (см. п. 1).
3. «Использовать ограничения» – признак проверки условий ограничений, установленных для группы клиентов. Условия ограничений на клиента проверяются после разделения объема групповой заявки на индивидуальные. Если заявка не удовлетворяет ограничениям, то ее объем снижается до такой величины, которая не будет нарушать все имеющиеся ограничения для данной группы клиентов.

4. «Купить на все средства» – признак возможности увеличения доли актива в группе даже при наличии в ней клиентов с недостаточными средствами: для этих клиентов активы будут закуплены на все доступные деньги, а для прочих клиентов доли актива будут доведены до указанной. Только для заявок на покупку в режиме «Повысить до .. %».
5. «Видимое кол-во» – видимое количество для заявки типа «Айсберг». Если в поле введено значение, отличное от 0, то индивидуальные заявки, образованные групповой заявкой, подаются с использованием алгоритма Айсберг.

Настройки программы, относящихся к работе с заявками, находятся в пункте меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, на вкладке «Торговля» / Заявки».

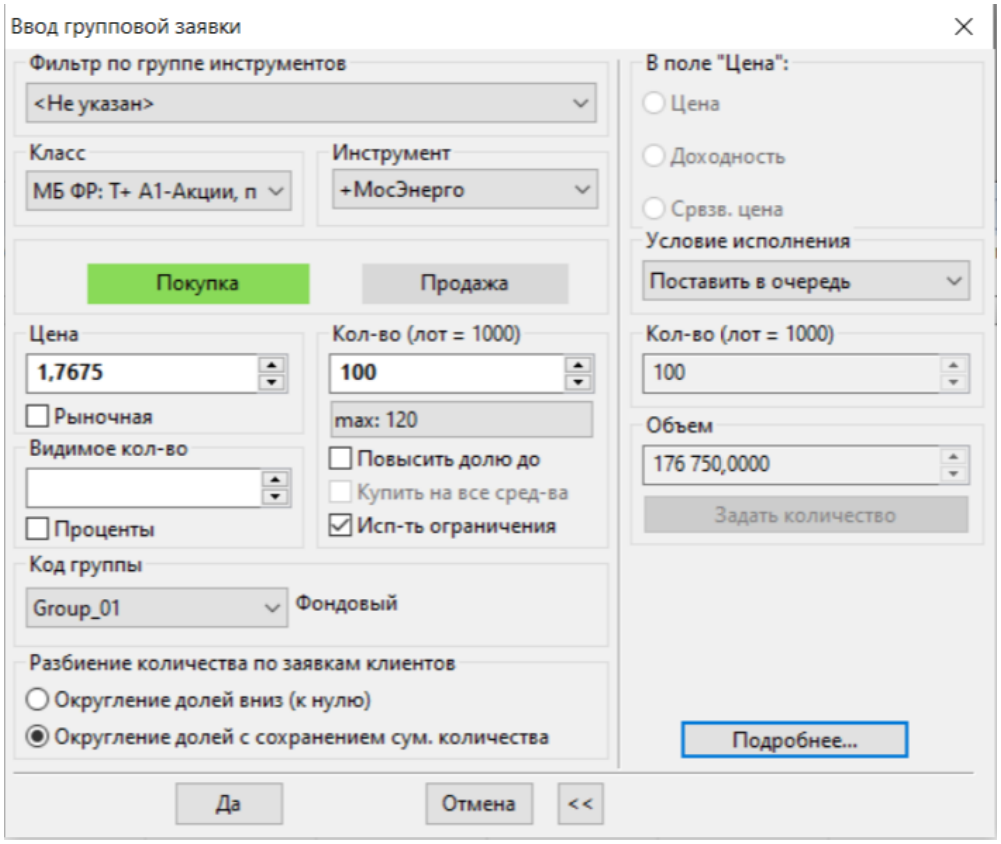
6.1.1 Ввод групповой заявки

меню **Расширения / TrustManager / Подать групповую заявку...**

Открыть окно создания групповой заявки можно одним из следующих способов:

1. из таблиц модуля TrustManager:
   - Нажатием клавиши «F2»;
   - Нажатием кнопки на панели инструментов;
   - Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая заявка».
2. из Таблицы текущих торгов, Таблицы котировок, Таблицы заявок, Таблицы стоп-заявок, Таблицы сделок Рабочего места QUIK:
   - Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая заявка».

Если в строке таблицы, из которой вызывается окно ввода заявки, указан инструмент, который присутствует в разных классах, то на экране появится список инструментов с указанием классов для выбора требуемого инструмента.



В окне доступны следующие параметры:

1. «Фильтр по группе инструментов» – выбор группы инструментов для использования в качестве фильтра. Если в этом поле выбрана группа, то в поле «Класс инструментов» отображаются только классы, входящие в выбранную группу. Если в поле выбрана пустая строка, то фильтр не используется. Данное поле отображается в окне ввода заявки, если в настройках модуля (пункт меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Торговля» / «Заявки») включен флажок «Разрешить фильтр по группам инструментов».
2. «Класс» – класс, к которому относится инструмент (доступен выбор OMS-классов). После выбора класса становятся доступными списки инструментов и коды группы.
3. «Инструмент» – наименование инструмента.
4. Направление операции – «Покупка» или «Продажа».
5. «Цена» – цена лимитированной заявки за единицу инструмента. Если включен флажок «Рыночная», то заявка имеет тип «Рыночная», при этом для спот-рынка в поле «Цена» устанавливается значение «0».
6. «Видимое кол-во» – видимое количество для заявки типа «Айсберг». Если в поле введено значение, отличное от 0, то индивидуальные заявки, образованные данной групповой заявкой, подаются с типом «Айсберг». При этом значение поля «Видимое кол-во» распределяется в тех же пропорциях, что и значение поля «Кол-во». Значение данного поля не должно превышать значение поля «Кол-во».

   Если включен флажок «Проценты» (процент от количества), то видимое количество для каждой индивидуальной заявки вычисляется как процент от значения, указанного в поле

«Количество». При этом поле «Видимое кол-во» может содержать любое значение в диапазоне от 1 до 99. По умолчанию флажок снят.

Поле и флажок доступны, если по выбранному классу разрешена подача айсберг-заявок.

7. «Код группы» – код группы клиентов. После выбора инструмента и кода группы в заявке отображаются максимальные значения объема заявки.
8. «Кол-во» – объем заявки. Величина лота для выбранного инструмента указана в скобках. В поле «max:» отображается максимально возможный объем заявки выбранной направленности (на покупку либо на продажу). На величину максимального объема влияют изменение цены и назначенные ограничения.
9. «Повысить (Понизить) долю до … %» – признак указания в качестве количества инструментов в заявке желаемого отношения (доля) стоимости инструмента в стоимости суммарных активов группы, в процентах. В полной форме ввода групповой заявки в поле «Кол-во» отображаются установленные проценты, пересчитанные в количество с учетом лотности. В поле «Объем» отображается оценка групповой заявки в денежном выражении.

> **Флажок «Повысить (Понизить) до … %» включен по умолчанию, если в меню Расширения / TrustManager / Настройки..., на вкладке «Торговля» / «Заявки» установлен флажок «Объём заявки как изменение доли актива в портфеле».**

10. «Купить на все сред-ва» – повысить в портфелях клиентов группы долю выбранного актива до величины, указанной в поле «Кол-во», а при недостатке средств клиента – купить этот актив на все имеющиеся деньги.

> **Флажок «Купить на все сред-ва» установлен по умолчанию в окне ввода групповой заявки, открытом с направлением «Покупка», если в настройках включен флажок «Купить на всё при подаче новой заявки» (меню Расширения / TrustManager / Настройки, на вкладке «Торговля» / «Заявки»). Если окно ввода групповой заявки открыто с направлением «Продажа», то при изменении направления операции на «Покупка» флажок «Купить на все сред-ва» выключается.**

11. «Исп-ть ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
12. «Разбиение количества по заявкам клиентов» – способ разделения объема групповой заявки по индивидуальным заявкам:

    - «Округление долей вниз (к нулю)» – объемы заявок округляются вниз до ближайшего целого значения.
    - «Округление долей с сохранением суммарного количества» – объемы заявок могут округляться в любую сторону таким образом, чтобы суммарный объем заявок был равен объему групповой заявки (до проверки ограничений).

    Значение по умолчанию задается настройками (меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Торговля» / «Заявки»).

Применение полей в расширенной форме (правая панель, открываемая нажатием кнопки «>>») аналогично окну ввода заявки Рабочего места QUIK.

13. Кнопка «Подробнее» — просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок.

В таблице просмотра информации расчётного количества по отдельным клиентским счетам по каждому клиенту из текущей группы отображается:

- «Код клиента» — код клиента групповой заявки;
- «Количество» — количество, полученное при распределении указанного пользователем количества по отдельным клиентам.
- «Не более» — рассчитанная QMargin покупательная способность клиента по инструменту (с необходимыми параметрами заявки).
- «Ограничение» — код ограничения, если количество было уменьшено из-за него (при наличии нескольких ограничений показывается код ограничения, которое сильнее всего повлияло на возможное количество в заявке). Ограничения на суммарный портфель группы клиентов не показываются.

  Ограничение отображается при включенном признаке «Исп-ть ограничения» в форме ввода групповой заявки.
- «Кол-во для заявки» — итоговое количество по клиенту после учёта покупательной способности, применения ограничений и прочих коррекций.
- «Исходное количество» — количество, указанное пользователем. Если заявка заполнялась в режиме изменения доли актива (также закрытия позиций или покупки/продажи доли актива), то указывается количество, рассчитанное для требуемого изменения (без учёта покупательной способности и ограничений).
- «В групповой заявке» — суммарное количество, которое было рассчитано по клиентам.

Внутри таблицы доступна сортировка.

Для выхода из таблицы нажмите кнопку «Закрыть».

Ввод заявки завершается нажатием кнопки «Да». Нажатие кнопки «Отмена» отменяет ввод заявки и закрывает окно.

> **Если окно ввода заявки вызвано из таблицы, то параметры заявки частично заполняются информацией из выбранной строки таблицы. Некоторые параметры заявки могут иметь значения по умолчанию, которые устанавливаются в настройках программы.**
> **Если пользователь задал ограничение «запрет на торговлю» для группы инструментов, то в случае соблюдения ограничений в форме ввода заявки для данных инструментов проставляется нулевой доступный объем, и выполнение торговых операций по этим инструментам невозможно.**
> **При подаче групповой заявки проверяется вхождение цены в диапазон цен, настроенный на Рабочем месте клиента.**

Если в программе QUIK Administrator в окне «Клиентские модули» для пользователя опция «Разрешить подачу заявок в направлении, улучшающем состояние нарушенного ограничения»:

- включена – для каждого клиента из группы вычисляется позиция после исполнения групповой заявки и проверяются ограничения. В случае присутствия хотя бы одного нарушения ограничения, информация о нём выводится в таблицу «Нарушения ограничений» и пользователь получает сообщение о нарушении. Далее пользователь получает предупреждение вида: «Неверно указано значение для поля «Кол-во (лот=N)». Количество лотов не может превышать <макс. число лотов>. При подаче количества <указанное количество> будет нарушено ограничение <описание ограничения>».
- отключена – в случае присутствия хотя бы одного нарушения ограничения, пользователь получает предупреждение вида: «Неверно указано значение для поля «Кол-во (лот=N)». Количество лотов не может превышать <макс. число лотов>».

Если в настройках Библиотеки расчетов лимитов включена настройка «Не блокировать средства для стоп-заявок по классам», то для классов, указанных в этой настройке, отключается проверка на максимальное количество при подаче групповых стоп-заявок и стоп-заявок через Клиентское место QUIK. При этом групповые заявки распределяются пропорционально стоимости портфеля.

Если включена настройка «Отображать нарушения ограничений при подаче заявок», то при проверке заявки, поданной через Клиентское место, выполняется проверка того, что все ограничения будут выполнены после выполнения данной заявки, и запоминается, какое ограничение будет нарушено. Если в ходе проверки обнаружено нарушение ограничения, то в окне «Нарушения ограничений» отображается сообщение о нарушении. После обнаружения нарушения одного ограничения прочие ограничения не проверяются на предмет нарушений.

Примеры использования:

1. Нужно довести долю какой-то ценной бумаги (например, «ао Сбербанк») до заданного уровня 10%.

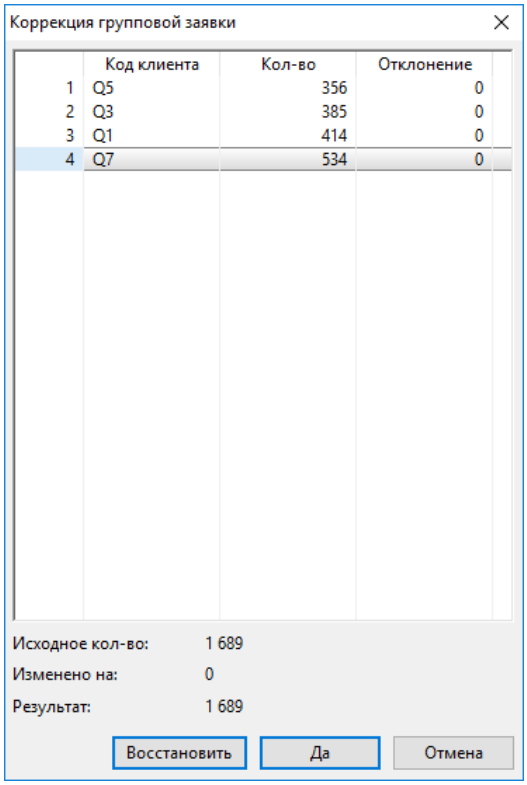
   _ В заявке указывается «Покупка», «Повысить до = 10 %».

2. Нужно понизить долю какого-то инструмента в портфелях клиентов до заданного уровня 15%, соблюдая ограничения (например, если продажа инструментов понижает долю группы инструментов ниже уровня, заданного в ограничении, то объем заявки должен быть уменьшен до величины, не критичной для ограничения).

   _ В заявке указывается «Продажа», «Понизить до = 15 %», флажок «Исп-ть ограничения» должен быть включен.

6.1.2 Редактирование сформированного пакета заявок

Если в настройках программы (пункт меню **Расширения / TrustManager / Настройки…**, вкладка «Торговля» / «Заявки») включен признак «Разрешить ручную коррекцию групповых заявок», то после завершения формирования групповой заявки нажатием кнопки «Да» откроется окно «Коррекция групповой заявки». В этом окне показывается объем сформированных заявок по каждому коду клиента в группе, который можно отредактировать. Для этого нужно выбрать нужную строку и ввести новое значение в колонке «Кол-во».



Значение параметров окна:

1. «Код клиента» – код клиента.
2. «Кол-во» – количество лотов в индивидуальной заявке.
3. «Отклонение» – величина изменения объема заявки вручную, по отношению к автоматически сгенерированному объему.
4. «Исходное кол-во» – объем групповой заявки до внесения изменений.
5. «Изменено на…» – величина изменения объема групповой заявки.
6. «Результат» – объем групповой заявки после внесения изменений.

Нажатием кнопки «Восстановить» отменяются изменения объемов вручную.

Нажатием кнопки «Да» в торговую систему будут переданы заявки с учетом корректировки объемов заявки вручную. Нажатием кнопки «Отмена» подача групповой заявки отменяется.

6.1.3 Замена групповой заявки

Групповые заявки, имеющие статус «Активна» или «Исполнена (частично)» в поле «Результат» таблицы «Групповые заявки», можно заменять. При замене заявки сначала отзываются все неисполненные поручения из торговой системы, а затем в торговую систему передается новый пакет поручений с новыми значениями цены и количества.

Замена заявки выполняется следующим образом:

1. В таблице «Групповые заявки» выбирается строка с заявкой, которую планируется заменить.
2. Окно редактирования заявки вызывается одним из следующих способов:
   - Нажатием кнопки на панели инструментов;
   - Нажатием клавиш «Ctrl»+«A»;
   - Выбором пункта контекстного меню «Заменить заявку».
3. В открывшемся окне можно изменить значение параметров «Кол-во» (для групповой заявки со статусом «Активна», если индивидуальные заявки, образованные ей, имеют статус «Активна») и «Цена».
4. Нажатием кнопки «Да» окно редактирования закрывается и выполняется замена заявки. Нажатием кнопки «Назад» отменяется редактирование заявки, снятые заявки заново передаются в торговую систему. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования заявки закрывается без дальнейших действий над заявками (снятые заявки остаются отозванными).

Результаты снятия/ввода заявок отображаются в «Окне сообщений».

6.1.4 Ввод групповой заявки на основании существующей

На основании уже существующей групповой заявки можно подать новую групповую заявку, все параметры которой будут совпадать с параметрами исходной групповой заявки. При этом изменить можно только направление заявки и цену. Вне зависимости от новой цены, объемы индивидуальных заявок, сформированных на основе скопированной групповой заявки, также останутся прежними.

Окно ввода копируемой заявки открывается выбором пункта контекстного меню «Повторить заявку» в таблице «Групповые заявки».

6.1.5 Снятие групповой заявки

Неисполненные групповые заявки можно отменить. Для снятия заявки выберите в таблице «Групповые заявки» строку с этой заявкой и выполните её отмену одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «Ctrl»+«D»;
- Выбором пункта контекстного меню «Снять заявку».

Результат снятия групповой заявки отображается в «Окне сообщений».

6.2 Таблица «Групповые заявки»

меню **Расширения / TrustManager / Групповые заявки**

6.2.1 Назначение

Таблица «Групповые заявки» предназначена для просмотра состояния исполнения групповых заявок. В таблице отображаются все групповые заявки, созданные пользователем TrustManager.

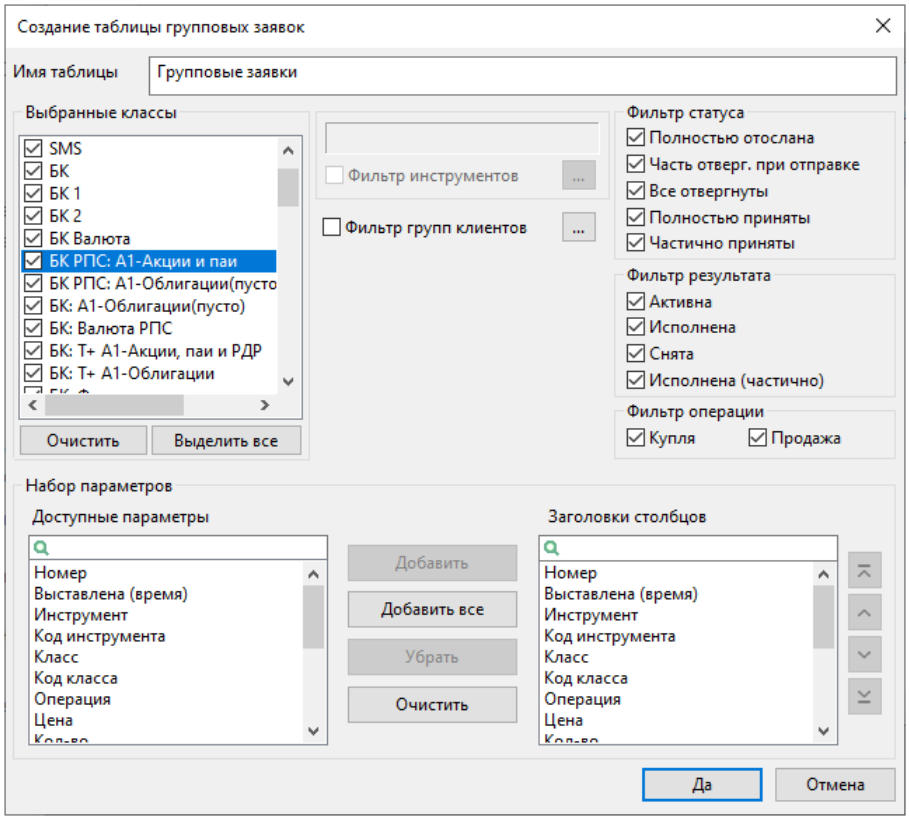
6.2.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию об отдельной групповой заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Номер групповой заявки в базе данных (заявки нумеруются начиная с «0»)
Выставлена (время)	Время регистрации групповой заявки
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе биржи
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Кол-во	Количество лотов, указанное в групповой заявке
Объем	Объем заявки в денежном выражении
Выставлено	Суммарное количество лотов в сформированных индивидуальных заявках
Остаток	Суммарное количество лотов в активных (неисполненных) индивидуальных заявках
Снято, отвергнуто	Количество лотов в заявках, которые не попали в торговую систему или были отозваны самим пользователем
Код группы	Код группы клиентов, по счетам которых подана групповая заявка

Заголовок	Назначение
Статус	Результат постановки заявок в торговую систему. Возможные значения: _ «Начальное состояние» – заявка подготовлена TrustManager к отправке на сервер QUIK и ожидает фактического подтверждения от сервера QUIK на её выставление в торговую систему; _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Отослана (частично)» – производится передача заявок в торговую систему; _ «Отослана» – передача заявок в торговую систему завершена; _ «Принята (частично)» – заявки приняты торговой системой частично, т.е. часть имеет статус «Активна», а часть – другие статусы; _ «Полностью приняты» – все заявки приняты торговой системой; _ «Отвергнута» – все заявки отвергнуты торговой системой либо сервером QUIK
Результат	Результат исполнения заявок в торговой системе. Возможные значения: _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Активна» – заявки приняты торговой системой, но не исполнены; _ «Исполнена (частично)» – часть заявок имеют статус «Исполнена»; _ «Исполнена» – все заявки имеют статус «Исполнена»; _ «Снята» – заявки отозваны пользователем
Видимое кол-во	Количество инструментов, выраженное в лотах, отображаемое в торговой системе. Поле заполняется только для заявок типа «Айсберг»

6.2.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Выбранные классы» – фильтр значений таблицы по полю «Код класса». Символом ☑ отмечены выбранные классы. Нажатием кнопки «Очистить» сбрасываются отметки по всему списку. Нажатием кнопки «Выделить все» выбираются все классы из списка.
3. «Фильтр инструментов» – фильтр значений таблицы по полю «Инструмент». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные инструменты».
4. «Фильтр групп клиентов» – фильтр значений таблицы по полю «Код группы». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные». Окно «Поиск» ниже списка кодов предназначено для поиска значений в списке. Фильтр имеет дополнительные параметры настройки:

   - «Включать в список выбранные» – в таблице будут отображены коды групп, перечисленные в списке «Выбранные».
   - «Исключать из списка выбранные» – в таблице будут отображены все коды групп, за исключением перечисленных в списке «Выбранные».
   - «Фильтровать по префиксу» – если признак выключен, то фильтр распространяется на точные совпадения значений с указанными в списке «Выбранные»; если признак включен, то фильтр распространяется на все значения, начинающиеся с указанных в фильтре комбинаций символов.
5. «Фильтр статуса» – фильтр значений таблицы по полю «Статус». Отметьте флажками статусы, требуемые для отображения.
6. «Фильтр результата» – фильтр значений таблицы по полю «Результат». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.

7. «Фильтр операции» – фильтр значений таблицы по направлению операции: «Купля» или «Продажа». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
8. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

Нажмите кнопку «Да», чтобы принять изменения. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования закроется без сохранения изменений.

6.2.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать заявки» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Заявки по групповой заявке [ ]» со списком индивидуальных заявок, сформированных на основании данной групповой заявки.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.
- «Заменить групповую заявку» (или «Ctrl»+«A») – заменить выбранную активную (неисполненную) групповую заявку.
- «Снять групповую заявку» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) групповую заявку.
- «Повторить групповую заявку» – ввести новую групповую заявку с условиями, аналогичными выбранной заявке.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.
- «Групповая стоп-заявка заявка "по исполнению"» – открыть окно ввода групповой стоп-заявки «по исполнению».

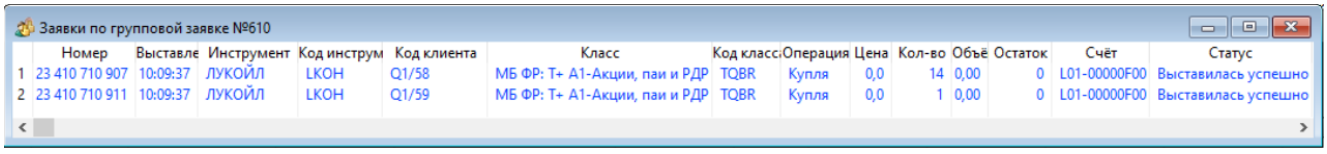
Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.3 Таблица «Заявки по групповой заявке [ ]»

6.3.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных заявок по счетам клиентов, сформированных на основе одной групповой заявки, номер которой указан в заголовке таблицы. Для просмотра состояния индивидуальных заявок, созданных на основе нескольких групповых заявок, используйте таблицу «Заявки».

Таблицу «Заявки по групповой заявке [ ]» можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Групповые заявки» или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать заявки».



6.3.2 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.3.3 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.
- «Снять заявку» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) заявку.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.4 Операции с групповыми стоп-заявками

Групповая стоп-заявка представляет собой поручение на создание пакета условных (стоп-) заявок по счетам группы клиентов.

В групповой стоп-заявке указывается общий объем стоп-заявок для всей группы клиентов, который затем автоматически разделяется на несколько индивидуальных стоп-заявок пропорционально величине доступных средств каждого клиента. При распределении объема групповой стоп-заявки по индивидуальным стоп-заявкам осуществляется округление объемов в соответствии с правилом, выбранном при вводе заявки.

Сформированный пакет стоп-заявок передается на сервер QUIK, который в дальнейшем осуществляет контроль их условий.

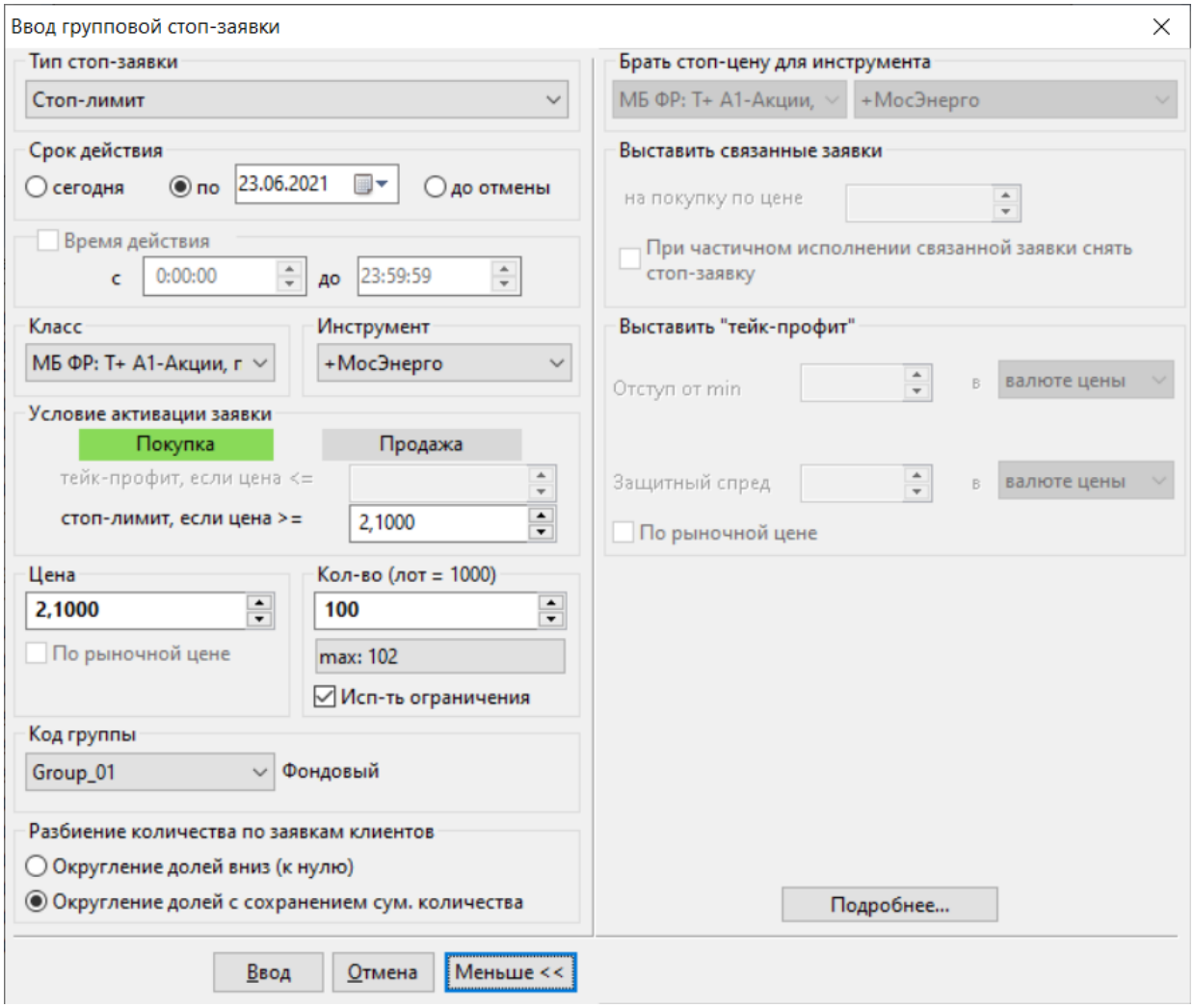
6.4.1 Ввод групповой стоп-заявки

Окно ввода новой групповой стоп-заявки может быть вызвано одним из следующих способов:

1. из таблиц модуля TrustManager:
   - нажатием кнопки на панели инструментов;
   - нажатием клавиши «F6»;
   - выбором в таблице пункта контекстного меню «Новая групповая стоп-заявка».
2. из Таблицы текущих торгов, Таблицы котировок, Таблицы заявок, Таблицы сделок Рабочего места QUIK:
   - Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая стоп-заявка».

Если в строке таблицы, из которой вызывается окно ввода заявки, указан инструмент, который присутствует в разных классах, то на экране появится список инструментов с указанием классов для выбора требуемого инструмента.

С помощью одной формы ввода можно формировать стоп-заявки разных типов. Дополнительные условия заявки отображаются в расширенной форме, вызываемой нажатием кнопки «Больше >>» или выбором типа условной заявки, для которой предназначены эти дополнительные условия.



В открывшемся окне последовательно заполните следующие поля:

1. «Тип стоп-заявки» – тип поручения. Каждому типу соответствуют определенные поля. При необходимости окно ввода заявки принимает расширенную форму. Возможные значения:

   - «Стоп-лимит»;
   - «Стоп-цена по другому инструменту»;
   - «Со связ. заявкой»;
   - «Тейк-профит»;
   - «Тейк-профит и стоп-лимит».

2. «Срок действия». Если выбрано значение «сегодня», то поручение действительно до конца текущего дня, иначе поручение действительно до даты, выбранной в поле «по…», или до отмены поручения, если выбрано значение «до отмены».

> **Стоп-заявки типа «Со связ. заявкой» действительны в течение текущей торговой сессии.**

3. «Время действия заявки» – период времени, в течение которого проверяются условия стоп-заявки. Параметр поручений типа «Тейк-профит и стоп-лимит». Если флажок отключен, то параметр не используется. При включенном флажке необходимо указать в поле «с…» – время начала действия стоп-заявки, а в поле «до…» – время окончания.

> 1. **Параметр «Время действия заявки» определяет интервал времени, в течение которого проверяется условие активации стоп-заявки. Если заявка активировалась, то проверка времени действия прекращается. Например, если для заявки типа «Тейк-профит и стоп-лимит» цена пробила уровень тейк-профит (заявка сработала, начался расчет минимума/максимума цены), но заявка не исполнилась до окончания заданного интервала времени внутри дня, то расчет максимума/ минимума цены не прекращается по истечении заданного периода времени.**
> 2. **Если значения времени «С…» и «До…» совпадают, то считается, что задан интервал с указанного времени текущего дня, до аналогичного времени следующего дня. Если значение «До…» строго больше времени «С…», то время действия проверяется в течение текущего дня.**

4. «Класс инструментов» – класс, к которому относится инструмент. После выбора класса инструментов становятся доступными списки инструментов и коды группы.
5. «Инструмент» – инструмент из списка инструментов для данного класса.
6. «Условие активации заявки» – настройка условий активации заявки:

- Направление операции – «Покупка» или «Продажа».
- Выбор контролируемого условия стоп-цены по отношению к цене последней сделки по инструменту:
  - Для заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» условие имеет вид: «Если цена <=» (или «>=») и означает исполнение заявки, если цена последней сделки по другому инструменту пересечет указанное значение;
  - Для заявок типов «Стоп-лимит», «Со связанной заявкой» условие имеет вид «стоп-лимит, если цена <=» (или «>=») и означает выставление лимитированной заявки, если цена последней сделки пересекла указанное значение;
  - Для заявок типа «Тейк-профит» условие имеет вид «тейк-профит, если цена <=» (или «>=») и означает начало расчета минимума (максимума) цены последней сделки, если она пересекла указанное значение;
  - Для заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит» доступны условия 2) и 3), причем любое из них может не заполняться.

Значение стоп-цены указывается в окне справа от выбора условия.

7. «Цена» – цена лимитированной заявки, выставляемой в торговую систему при наступлении условия «Стоп-лимит», за одну единицу финансового инструмента.
8. «По рыночной цене» – признак исполнения стоп-заявки по рыночной цене. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

> **В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.**

9. «Кол-во (лот=…)» – количество инструментов, выраженное в лотах. В скобках указано количество единиц выбранного инструмента в одном лоте.
10. «max» – максимальное возможное количество лотов в стоп-заявке, рассчитанное из величины доступных средств клиента с учетом всех комиссий. Нажатием на кнопку указанное максимальное значение вводится в поле «Кол-во». Поле отображается при включенном в настройках Рабочего места QUIK флажке «Рассчитывать доступное количество» (см. Руководство пользователя QUIK, Раздел 5).
11. «Исп-ть ограничения» – при исполнении групповой стоп-заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
12. «Код группы» – код группы клиентов. После выбора инструмента и кода группы в заявке отображается максимально возможный объем заявки. Справа от поля отображается тип рынка выбранной группы, например, «Фондовый».
13. «Разбиение количества по заявкам клиентов» – способ разделения объема групповой заявки по индивидуальным заявкам:

    - «Округление долей вниз (к нулю)» – объемы заявок округляются вниз до ближайшего целого значения;
    - «Округление долей с сохранением суммарного количества» – объемы заявок могут округляться в любую сторону таким образом, чтобы суммарный объем заявок был равен объему групповой заявки.

Дополнительные параметры стоп-заявки, разворачивающиеся нажатием кнопки «Больше>>»:

14. «Брать стоп-цену для инструмента» – наименование и класс инструмента, по которому осуществляется контроль условия стоп-цены. Параметр поручения типа «Стоп-цена по другому инструменту».
15. «Выставить связанные заявки на покупку (продажу) по цене ..» – цена исполнения связанной лимитированной заявки. Параметр поручения типа «Со связанной заявкой».
16. «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» – если флажок установлен, то при частичном исполнении связанной лимитированной заявки стоп-заявка становится снятой. Если флажок снят, то при частичном исполнении связанной заявки объем стоп-заявки уменьшается до величин неисполненного остатка лимитированной заявки.
17. «Выставить «тейк-профит» – параметры заявки типа «Тейк-профит»:

    - «Отступ от max (min)» – устанавливает значение отступа от максимума (на продажу) или минимума (на покупку) цены последней сделки, при достижении которого будет сгенерирована лимитированная заявка. Значение отступа может указываться как в виде отклонения цены, так и в процентах.

- «Защитный спред» – устанавливает дополнительное (опережающее) отклонение цены заявки от цены последней сделки, инициировавшей заявку. Защитный спред предназначен для того, чтобы установить цену создаваемой заявки заведомо исполнимой.
- «По рыночной цене» – признак исполнения тейк-профита по рыночной цене. Значение параметра «Защитный спред» в данном случае не используется. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

18. «Подробнее» кнопка — просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

> **В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.**

6.4.2 Обработка результатов групповой стоп-заявки

При срабатывании групповой стоп-заявки автоматически создаётся новая групповая заявка, содержащая все заявки, созданные системой QUIK по результатам срабатывания соответствующих стоп-заявок, составляющих групповую стоп-заявку. Эта заявка также отображается в таблице «Групповые заявки».

6.4.3 Снятие групповой стоп-заявки

Групповые стоп-заявки со статусом «Активна» можно отменить.

Для этого нужно в таблице «Групповые стоп-заявки» выделить строку с выбранной стоп-заявкой и выполнить ее отмену одним из следующих способов:

- нажатием кнопки на панели инструментов;
- нажатием клавиш «Ctrl»+«D»;
- выбором пункта контекстного меню «Снять заявку».

Результат снятия групповой стоп-заявки отображается в «Окне сообщений».

6.4.4 Замена групповой стоп-заявки

Активные групповые стоп-заявки доступны для редактирования. **Активными** считаются заявки, которые имеют состояние «Активна» в поле «Результат» таблицы «Групповые стоп-заявки». При замене заявки сначала отзываются все неисполненные поручения из торговой системы, а затем в торговую систему передается новый пакет поручений с новыми значениями цены и количества.

Замена заявки выполняется следующим образом:

1. В таблице «Групповые стоп-заявки» выбирается строка со стоп-заявкой, которую планируется заменить.

2. Окно редактирования заявки вызывается одним из следующих способов:
   - Нажатием кнопки на панели инструментов;
   - Нажатием клавиш «Ctrl»+«A»;
   - Выбором пункта контекстного меню «Заменить групповую стоп-заявку».
3. В открывшемся окне изменяются значения параметров. Для редактирования доступны ценовые параметры, значения отступа, защитного спреда (параметры заявок «Тейк-профит») и количества.
4. Нажатием кнопки «Да» окно редактирования закрывается и выполняется замена стоп-заявки. Нажатием кнопки «Назад» отменяется редактирование заявки, снятые заявки заново передаются в торговую систему. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования заявки закрывается без дальнейших действий над заявками (снятые заявки остаются отозванными).

Результаты снятия/ввода заявок отображаются в «Окне сообщений».

6.4.5 Принудительное исполнение групповой стоп-заявки

Активные условные заявки, хранимые на сервере QUIK, исполняются при наступлении условия стоп-цены. Если необходимо, можно исполнить активную условную заявку принудительно, отвергнув условие стоп-цены. Функция доступна в таблицах «Групповые стоп-заявки» и «Стоп-заявки по групповой стоп-заявке [ ]» и выполняется одним из следующих способов:

- Нажатием клавиш «Alt»+«F6»;
- Выбором пункта контекстного меню «Активировать групповую стоп-заявку» на выделенной строке.

В случае принудительной активации заявок типа «Тейк-профит», «Тейк-профит по исполнению», «Тейк-профит и стоп-лимит», «Тейк-профит и стоп-лимит по исполнению» выставляется заявка по цене последней сделки +/- защитный спред. Если с момента выставления тейк-профита сделок по данному инструменту не было, то заявка будет выставлена по цене «Условие активации тейк-профита» +/- защитный спред.

6.5 Таблица «Групповые стоп-заявки»

меню **Расширения / TrustManager / Групповые стоп-заявки…**

6.5.1 Назначение

Таблица «Групповые стоп-заявки» предназначена для просмотра состояния исполнения групповых условных (стоп-) заявок. В таблице отображаются все групповые стоп-заявки, созданные пользователем.

6.5.2 Формат таблицы

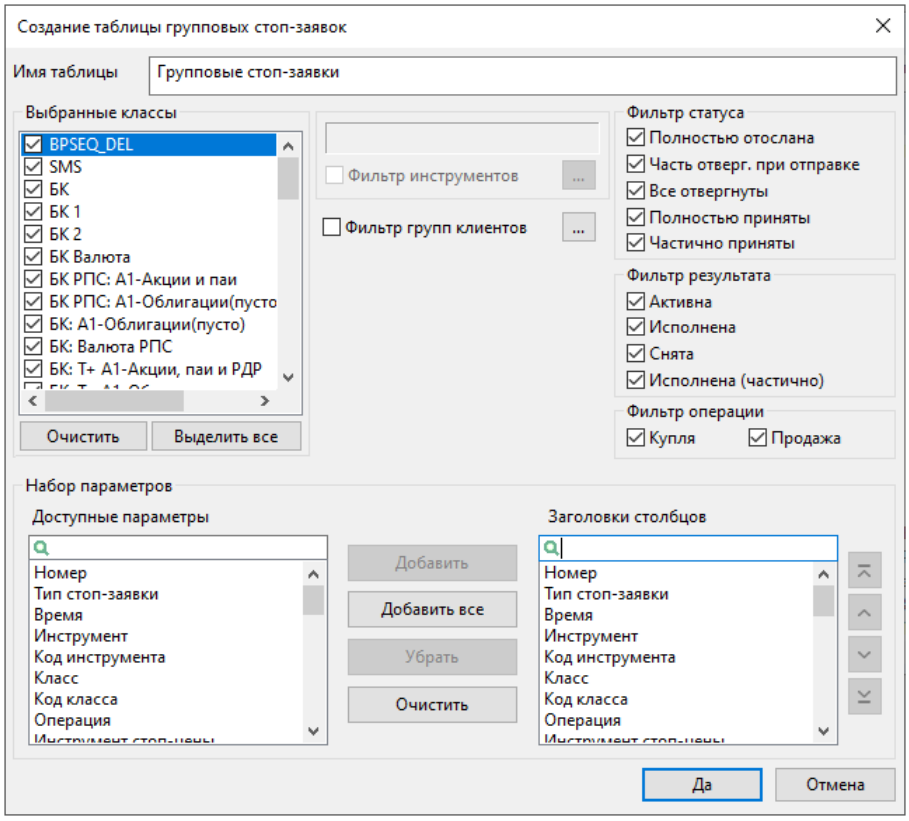
Каждая строка таблицы содержит информацию об отдельной групповой стоп-заявке.
В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Номер групповой стоп-заявки в базе данных (заявки нумеруются начиная с «0»)
Тип стоп-заявки	Тип поручения
Время	Время регистрации групповой стоп-заявки
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе биржи
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Инструмент стоп-цены	Для стоп-заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» указывается инструмент, по которому проверяется условие. Для других типов стоп-заявок поле пустое
Код инструмента стоп-цены	Идентификатор инструмента, по которому проверяется условие
Класс стоп-цены	Наименования класса инструмента, по которому проверяется условие
Код класса стоп-цены	Код класса инструмента, по которому проверяется условие
Стоп-цена	Цена условия, при котором происходит начало расчета максимума (минимума) цены для заявок типа «тейк-профит», за единицу инструмента. Для заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» в поле показывается значение параметра «если цена <=».
Направление стоп-цены	Отношение цены последней сделки к стоп-цене, активирующей стоп-заявку, в виде «<=» или «>=»
Стоп-лимит цена	Цена условия, при котором происходит выставление заявок типа «стоп-лимит» и «со связанной заявкой», за единицу инструмента. Для заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» в поле показывается значение параметра «если цена >=»
Направление стоп-лимит цены	Отношение стоп-лимит цены к цене последней сделки в виде «<=» или «>=»
Цена	Цена заявки, за единицу инструмента
Стоп-лимит по рыночной	Признак исполнения заявки «Стоп-лимит» по рыночной цене: «Да» – рыночная, «Нет» – лимитированная

Заголовок	Назначение
Цена св. заявки	Цена, указанная в связанной заявке
Отступ	Величина отступа. Параметр заявок типа «Тейк-профит»
Защитный спред	Дополнительное отклонение цены заявки от цены последней сделки, инициировавшей исполнение условной заявки. Параметр заявок типа «Тейк-профит»
Тейк-профит по рыночной	Признак исполнения заявки «Тейк-профит» по рыночной цене: «Да» – рыночная, «Нет» – лимитированная
Срок	Срок исполнения заявки в виде даты, либо значение «До отмены»
Активна с	Время начала действия стоп-заявки
Активна по	Время окончания действия стоп-заявки
Кол-во	Количество лотов, указанное в групповой стоп-заявке
Выставлено	Суммарное количество лотов в сформированных индивидуальных стоп-заявках
Акт. кол-во	Суммарное количество лотов в активных (неисполненных) индивидуальных стоп-заявках
Снято, отвергнуто	Количество лотов в стоп-заявках, отвергнутых сервером или отозванных самим пользователем
Код группы	Код группы клиентов, по счетам которых подана групповая стоп-заявка
Статус	Результат отправки стоп-заявок на сервер QUIK. Возможные значения: _ «Начальное состояние» – стоп-заявка подготовлена TrustManager к отправке на сервер QUIK и ожидает фактического подтверждения от сервера QUIK на её выставление в торговую систему; _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных стоп-заявок; _ «Отослана (частично)» – производится передача заявок на сервер; _ «Отослана» – передача заявок на сервер завершена; _ «Принята (частично)» – заявки приняты сервером частично, т.е. часть имеет статус «Активна», а часть – другие статусы; _ «Полностью приняты» – все заявки приняты сервером; _ «Отвергнута» – все заявки отвергнуты сервером QUIK
Результат	Результат исполнения стоп-заявок сервером QUIK. Возможные значения: _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Активна» – заявки приняты сервером, но не исполнены; _ «Исполнена (частично)» – часть заявок имеют статус «Исполнена»; _ «Исполнена» – все заявки имеют статус «Исполнена»; _ «Снята» – заявки отозваны пользователем

Заголовок	Назначение
Тип	Тип заявки, код из нескольких символов. Используется для заявок типа «тейк-профит», «стоп-цена по другому инструменту» и «по исполнению». Используемые значения: _ «Ч» – признак частичного исполнения заявки-условия; _ «И» – признак использования в качестве количества инструментов в заявке «по исполнению» исполненного объема заявки-условия; _ Единицы измерения отступа для заявок «тейк-профит». Возможные значения: «%» – в процентах, «Д» – в единицах цены; _ Единицы измерения защитного интервала для заявок «тейк-профит». Возможные значения: «%» – в процентах, «Д» – в единицах цены
№ связанной заявки	Регистрационный номер заявки в торговой системе, присвоенный связанной заявке
№ гр. заявки условия	Регистрационный номер групповой заявки-условия в торговой системе. Параметр стоп-заявок типа «по исполнению»
№ гр. заявки	Номер групповой заявки, созданной в результате срабатывания групповой стоп-заявки

6.5.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.

2. «Выбранные классы» – фильтр значений таблицы по полю «Код класса». Символом ☑ отмечены выбранные классы. Нажатием кнопки «Очистить» сбрасываются отметки по всему списку. Нажатием кнопки «Выделить все» выбираются все классы из списка.
3. «Фильтр инструментов» – фильтр значений таблицы по полю «Инструмент». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные инструменты».
4. «Фильтр групп клиентов» – фильтр значений таблицы по полю «Код группы». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные». Окно «Поиск» ниже списка кодов предназначено для поиска значений в списке. Фильтр имеет дополнительные параметры настройки:

   - «Включать в список выбранные» – означает, что в таблице будут отображены коды групп, перечисленные в списке «Выбранные».
   - «Исключать из списка выбранные» – означает, что в таблице будут отображены все коды групп, за исключением перечисленных в списке «Выбранные».
   - «Фильтровать по префиксу» – если признак выключен, то фильтр распространяется на точные совпадения значений с указанными в списке «Выбранные»; если признак включен, то фильтр распространяется на все значения, начинающиеся с указанных в фильтре комбинаций символов.
5. «Фильтр статуса» – фильтр значений таблицы по полю «Статус». Отметьте флажками статусы, требуемые для отображения.
6. «Фильтр результата» – фильтр значений таблицы по полю «Результат». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
7. «Фильтр операции» – фильтр значений таблицы по направлению операции: «Купля» или «Продажа». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
8. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

Нажмите кнопку «Да», чтобы принять изменения. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования закроется без сохранения изменений.

6.5.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Операции, доступные из контекстного меню:

- «Показать стоп-заявки» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Стоп-заявки по групповой стоп-заявке [ ]» со списком индивидуальных стоп-заявок, сформированных на основании данной групповой стоп-заявки.
- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.
- «Заменить групповую стоп-заявку» (или «Ctrl»+«A») – заменить выбранную активную (неисполненную) групповую стоп-заявку.
- «Активировать групповую стоп-заявку» (или «Alt»+«F6») – активировать (принудительно исполнить) выбранную групповую стоп-заявку.
- «Снять стоп-заявку» (или «Ctrl»+«D») – удалить выбранную активную групповую стоп-заявку.

- «Повторить групповую стоп-заявку» – ввести новую групповую заявку с условиями, аналогичными выбранной заявке.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.6 Таблица «Стоп-заявки по групповой стоп-заявке [ ]»

6.6.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных стоп-заявок по счетам клиентов, сформированных на основе одной групповой стоп-заявки, номер которой указан в заголовке таблицы. Для просмотра состояния индивидуальных заявок, созданных на основе нескольких групповых заявок, используйте таблицу «Стоп-заявки».

Таблицу можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Групповые стоп-заявки», или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать стоп-заявки».

6.6.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельной стоп-заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Регистрационный номер заявки на сервере QUIK. Если заявка была отвергнута, то она не имеет номера, и вместо него отображается знак «?»
Тип стоп-заявки	Тип поручения
Время	Время регистрации заявки на сервере
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Счет	Код торгового счета, по которому подана заявка
Инструмент стоп-цены	Для стоп-заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» указывается инструмент, по которому проверяется условие. Для других типов стоп-заявок поле пустое

Заголовок	Назначение
Код инструмента стоп-цены	Идентификатор инструмента, по которому проверяется условие
Класс стоп-цены	Наименования класса инструмента, по которому проверяется условие
Код класса стоп цены	Код класса инструмента, по которому проверяется условие
Стоп-цена	Цена условия, за единицу инструмента
Направление стоп-цены	Отношение цены последней сделки к стоп-цене, активирующей стоп-заявку, в виде «<=» или «>=»
Стоп-лимит цена	Цена условия, при котором происходит выставление заявок типа «стоп-лимит» и «со связанной заявкой», за единицу инструмента. Для заявок типа «Стоп-цена по другому инструменту» в поле показывается значение параметра «если цена >=»
Направление стоп-лимит цены	Отношение стоп-лимит цены к цене последней сделки в виде «<=» или «>=»
Цена	Цена заявки, за единицу инструмента
Стоп-лимит по рыночной	Признак исполнения заявки «Стоп-лимит» по рыночной цене: «Да» – рыночная, «Нет» – лимитированная
Цена св. заявки	Цена, указанная в связанной заявке
Отступ	Величина отступа. Параметр заявок типа «Тейк-профит»
Защитный спред	Дополнительное отклонение цены заявки от цены последней сделки, инициировавшей исполнение условной заявки. Параметр заявок типа «Тейк-профит».
Тейк-профит по рыночной	Признак исполнения заявки «Тейк-профит» по рыночной цене: «Да» – рыночная, «Нет» – лимитированная
Срок	Срок исполнения заявки в виде даты, либо значение «До отмены»
Активна с	Время начала действия стоп-заявки
Активна по	Время окончания действия стоп-заявки
Кол-во	Количество инструментов в стоп-заявке, в лотах
Акт. кол-во	Неисполненный остаток заявки, в лотах
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Состояние	Состояние исполнения стоп-заявки в настоящий момент на сервере QUIK («Рассчитывается min/max и ждет активации», «Активирована», «Исполнена», «Снята»)

Заголовок	Назначение
Статус	Состояние исполнения стоп-заявки в настоящий момент на сервере QUIK («Рассчитывается min/max и ждет активации», «Активирована», «Исполнена», «Снята»)
Результат	Результат исполнения стоп-заявки сервером QUIK. Возможные значения: _ «Активна» – заявки приняты сервером, но не исполнена; _ «Исполнена» – заявка исполнена сервером; _ «Снята» – заявка отозвана пользователем
Тип	Тип заявки, код из нескольких символов. Используется для заявок типа «тейк-профит», «стоп-цена по другому инструменту» и «по исполнению». Используемые значения: _ «Ч» – признак частичного исполнения заявки-условия; _ «И» – признак использования в качестве количества инструментов в заявке «по исполнению» исполненного объема заявки-условия; _ Единицы измерения отступа для заявок «тейк-профит». Возможные значения: «%» – в процентах, «Д» – в единицах цены; _ Единицы измерения защитного интервала для заявок «тейк-профит». Возможные значения: «%» – в процентах, «Д» – в единицах цены
№ связанной заявки	Регистрационный номер заявки в торговой системе, присвоенный связанной заявке
№ заявки условия	Регистрационный номер заявки-условия в торговой системе. Параметр стоп-заявок типа «по исполнению»
№ заявки	Номер заявки, созданной в результате срабатывания стоп-заявки
Идентификатор	Ключ для экспорта по ODBC

6.6.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.6.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Операции, доступные из контекстного меню:

- «Новая групповая стоп-заявка» (или «F6») – открыть окно ввода групповой стоп-заявки.
- «Снять стоп-заявку» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) стоп-заявку.
- «Активировать стоп-заявку» (или «Alt»+«F6») – активировать (принудительно исполнить) выбранную стоп-заявку.
- «Новая групповая заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой заявки.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.7 Операции с заявками «по исполнению»

Заявки «по исполнению» представляют собой условные заявки, условием активации (начала проверки их стоп-цены сервером QUIK) которых является исполнение определенной активной заявки (далее называемой «заявкой-условием»). Такие заявки могут применяться, например, для закрытия позиции по инструменту, открываемой данной активной заявкой.

Исполнение одной активной заявки может вызывать активацию нескольких заявок «по исполнению» разных типов.

6.7.1 Применение заявок «по исполнению»:

Сервером QUIK поддерживается следующие типы заявок «по исполнению»:

- «Стоп-лимит по заявке»;
- «Тейк-профит по заявке»;
- «Тейк-профит и стоп-лимит по заявке».

После исполнения заявки-условия они порождают заявки типа «Стоп-лимит», «Тейк-профит» и «Тейк-профит и стоп-лимит» соответственно, со стандартным набором параметров для этих типов заявок (подробнее см. п. «Ввод групповой стоп-заявки»). Для просмотра списка заявок «по исполнению» и их текущего состояния используется таблица «Групповые стоп-заявки».

Срок действия заявок «по исполнению» – до окончания текущей торговой сессии, т.е. пока заявка-условие может быть активной.

Параметры «Класс», «Инструмент», «Счет», «Код клиента», «Поручение» для заявки «по исполнению» заимствуются из заявки-условия.

Направленность заявки «по исполнению» всегда противоположная к заявке-условию. Например, если заявка-условие имеет направленность «на покупку», то заявка «по исполнению» будет «на продажу».

Если в момент активации заявки «по исполнению» количество доступных средств недостаточно для выполнения заявки, то такая заявка не активируется и становится «Снятой».

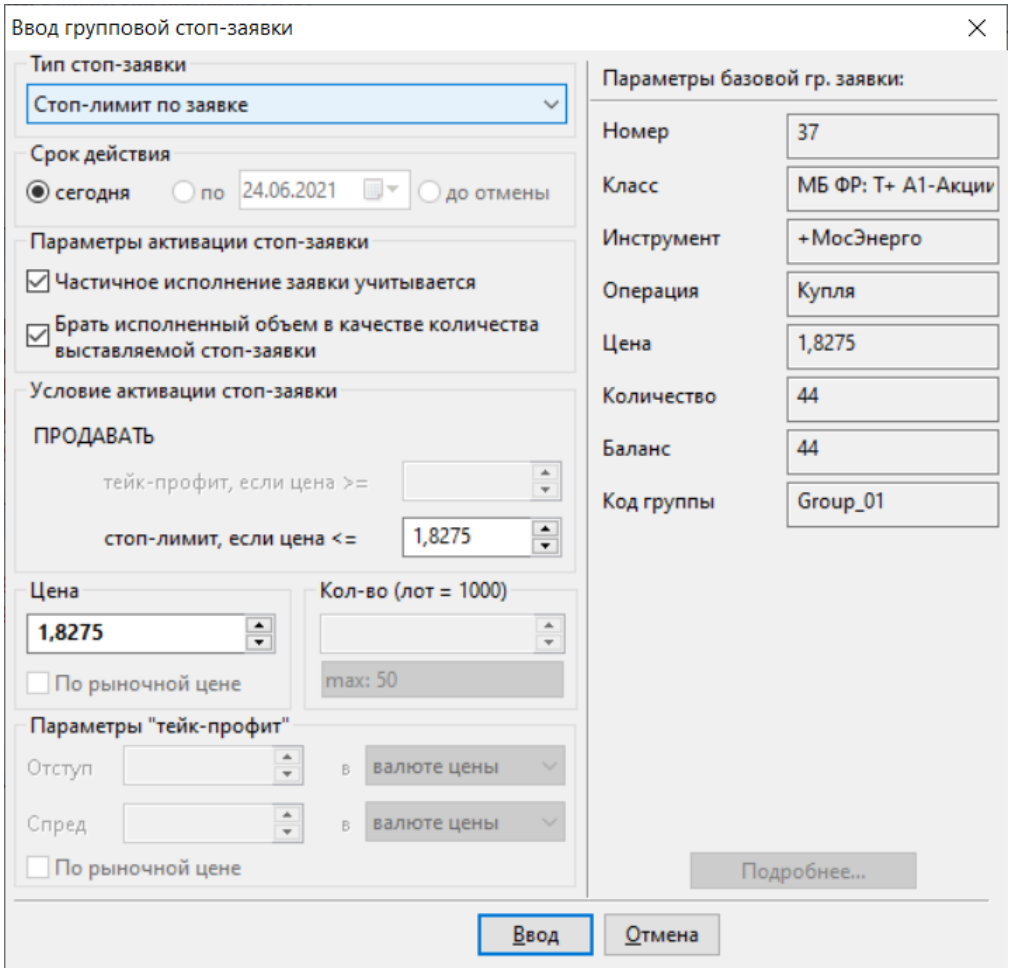
Если заявка-условие была снята или отвергнута торговой системой, то снимаются все связанные с ней заявки «по исполнению».

6.7.2 Ввод заявки «по исполнению»

Ввод заявки «по исполнению» осуществляется выбором в таблице «Групповые заявки» пункта контекстного меню «Групповая стоп-заявка "по исполнению"». В окне ввода заявки

слева находятся поля для ввода параметров заявки «по исполнению», а справа – параметры базовой групповой заявки (т.е. заявки-условия).

Значения параметров заявки «по исполнению»:



1. «Тип стоп-заявки» – выбор типа заявки: «Стоп-лимит по заявке», «Тейк профит и стоп-лимит по заявке» или «Тейк-профит по заявке».
2. «Параметры активации стоп-заявки» определяют поведение заявки «по исполнению» в случае исполнения заявки-условия:

   - «Частичное исполнение заявки учитывается» – заявка «по исполнению» будет активирована при частичном исполнении заявки-условия. Если флажок снят, то заявка «по исполнению» активируется только при полном исполнении заявки-условия.
   - «Брать остаток заявки в качестве количества выставляемой стоп-заявки» – в качестве количества инструментов в заявке «по исполнению» принимается исполненный объем заявки-условия. Если этот флажок снят, то объем заявки указывается явно, в поле «Количество».

   > **Если установлены оба флажка, при частичном исполнении заявки-условия происходит активация заявки «по исполнению» с указанием количества инструментов, равным объему исполненной части заявки-условия. При дальнейшем исполнении заявки условия происходит увеличение объема заявки «по исполнению». При этом, в зависимости**

> **от движения цен на рынке, возможно наступление условий исполнения заявки «по исполнению» для активированного объема, а затем снова может происходить увеличение активированного объема в результате следующего частичного исполнения заявки-условия.**

3. «Условие активации стоп-заявки» –тзначение стоп-цены и направленность заявки – «ПОКУПАТЬ» либо «ПРОДАВАТЬ».
4. «Цена» – цена заявки за единицу инструмента.
5. «По рыночной цене» – признак исполнения стоп-заявки по рыночной цене. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

> **В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.**

6. «Кол-во» – количество инструментов в заявке в лотах. Количество инструментов в одном лоте указано в заголовке поля в скобках. Параметр недоступен, если установлен флажок «Брать остаток заявки в качестве количества выставляемой стоп-заявки».
7. «Параметры тейк-профита» – параметры заявки типа «Тейк-профит по заявке»:

   - «Брать отступ от минимума» – значение отступа от максимума (на продажу) или минимума (на покупку) цены последней сделки, при достижении которого будет сгенерирована лимитированная заявка. Значение отступа может указываться как в виде отклонения цены, так и в процентах.
   - «Защитный спред» – дополнительное (опережающее) отклонение цены заявки от цены последней сделки, инициировавшей заявку. Защитный спред предназначен для того, чтобы установить цену создаваемой заявки заведомо исполнимой.
   - «По рыночной цене» – признак исполнения тейк-профита по рыночной цене. Значение параметра «Защитный спред» в данном случае не используется. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

     > **В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.**

8. «Подробнее» кнопка — просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Значения параметров базовой групповой заявки:

1. «Номер» – регистрационный номер групповой заявки-условия.
2. «Класс» – наименование класса в торговой системе, к которому относится инструмент.
3. «Инструмент» – наименование инструмента, указанного в заявке.
4. «Операция» – направленность операции заявки-условия.
5. «Цена» – цена заявки-условия, за единицу инструмента.

6. «Количество» – количество инструментов в заявке, в лотах.
7. «Баланс» – исполненная часть заявки-условия, в лотах.
8. «Код группы» – код группы, указанный в заявке-условии.

6.7.3 Замена и снятие заявки «по исполнению»

Снятие заявки «по исполнению» осуществляется из таблицы «Групповые стоп-заявки» таким же образом, как и снятие условных заявок других типов.

Процедура замены заявок «по исполнению» выполняется аналогично изменению групповой стоп-заявки и заключается в снятии одной заявки «по исполнению» и создании новой, с измененными условиями. Ее можно выполнить выбором пункта контекстного меню «Заменить групповую стоп-заявку» либо нажатием комбинации клавиш «Ctrl»+«A».

6.8 Операции с групповыми адресными заявками

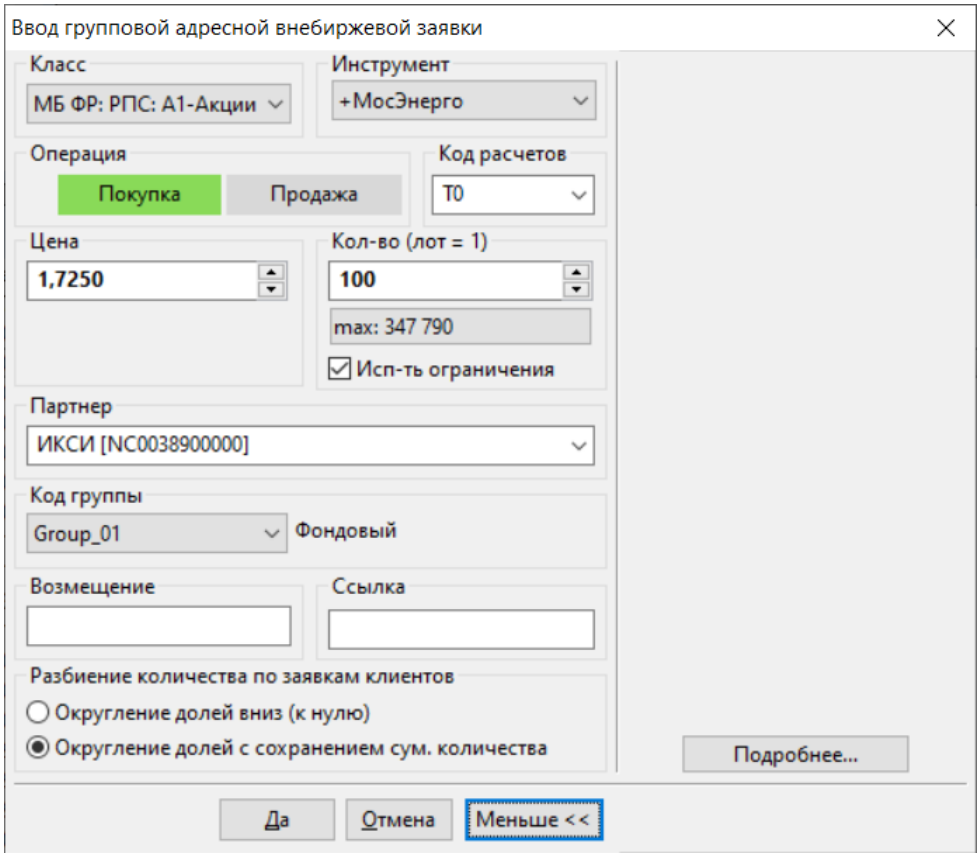
Групповая адресная заявка представляет собой поручение на создание пакета адресных заявок по счетам группы клиентов. Такие заявки могут использоваться для участия в аукционах по размещению инструментов.

6.8.1 Ввод групповой адресной заявки

Открыть окно создания групповой заявки можно одним из следующих способов:

- Выбором в меню программы пункта Рас**ширения / TrustManager / Подать групповую адресную заявку...**.
- Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая адресная заявка» в таблицах модуля, относящихся к адресным заявкам. Таблица при этом не должна быть пустой.
- Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая адресная заявка» в таблицах Рабочего места QUIK: Таблица текущих торгов, Таблица заявок на внебиржевые сделки, Таблица сделок.

В окне доступны параметры:



1. «Класс» – класс, к которому относится инструмент. После выбора класса становятся доступными списки инструментов и коды группы.
2. «Инструмент» – выбор наименования инструмента из списка доступных.
3. Направление операции – «Покупка» или «Продажа».
4. «Код расчетов».
5. «Цена» – цена заявки за единицу инструмента.
6. «Рыночная» – признак исполнения заявки по рыночной цене.
7. «Кол-во» – объем заявки в лотах. В поле «max» отображается максимально возможный объем заявки выбранной направленности (на покупку либо на продажу). На величину максимального объема влияют изменение цены и условие «Использовать ограничения».
8. «Использовать ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
9. «Партнер» – код участника торгов, являющегося партнером по сделке.
10. «Код группы» – код группы клиентов. После выбора инструмента и кода группы в заявке отображаются максимальные значения объема заявки. Справа от поля справочно отображается тип рынка выбранной группы, например, «Фондовый».
11. «Возмещение» – денежные средства, перечисляемые одним из контрагентов по сделке другому, в случае просрочки исполнения своих обязательств по сделке. Задается в процентах от суммы сделки. Обязательный параметр операций РЕПО.
12. «Ссылка» – текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Текстовая строка может состоять из любого сочетания букв и цифр и иметь длину не более 10 символов.
13. «Разбиение количества по заявкам клиентов» – способ разделения объема групповой заявки по индивидуальным заявкам:

- «Округление долей вниз (к нулю)» – объемы заявок округляются вниз до ближайшего целого значения.
- «Округление долей с сохранением суммарного количества» – объемы заявок могут округляться в любую сторону таким образом, чтобы суммарный объем заявок был равен объему групповой заявки (до проверки ограничений).

14. Кнопка «Подробнее» — просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Ввод заявки завершается нажатием кнопки «Да». Нажатие кнопки «Отмена» отменяет ввод заявки и закрывает окно.

6.8.2 Замена групповой адресной заявки

Замена групповых адресных заявок выполняется аналогично замене групповой заявки.

6.8.3 Ввод групповой адресной заявки на основании существующей

На основании уже существующей групповой адресной заявки можно подать новую заявку, все параметры которой будут совпадать с параметрами исходной заявки. При этом изменить можно только направление заявки и цену. Вне зависимости от новой цены, объемы индивидуальных заявок, сформированных на основе скопированной групповой адресной заявки, также останутся прежними.

Окно ввода копируемой заявки открывается выбором пункта контекстного меню «Повторить групповую адресную заявку» в таблице «Групповые адресные внебиржевые заявки».

6.8.4 Снятие групповой адресной заявки

Неисполненные групповые адресные заявки можно отменить.

Для снятия заявки выберите в таблице «Групповые адресные внебиржевые заявки» строку с этой заявкой и выполните ее отмену одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «Ctrl»+«D»;
- Выбором пункта контекстного меню «Снять групповую адресную заявку».

Результат снятия групповой заявки отображается в «Окне сообщений».

6.9 Операции с групповыми адресными заявками РЕПО

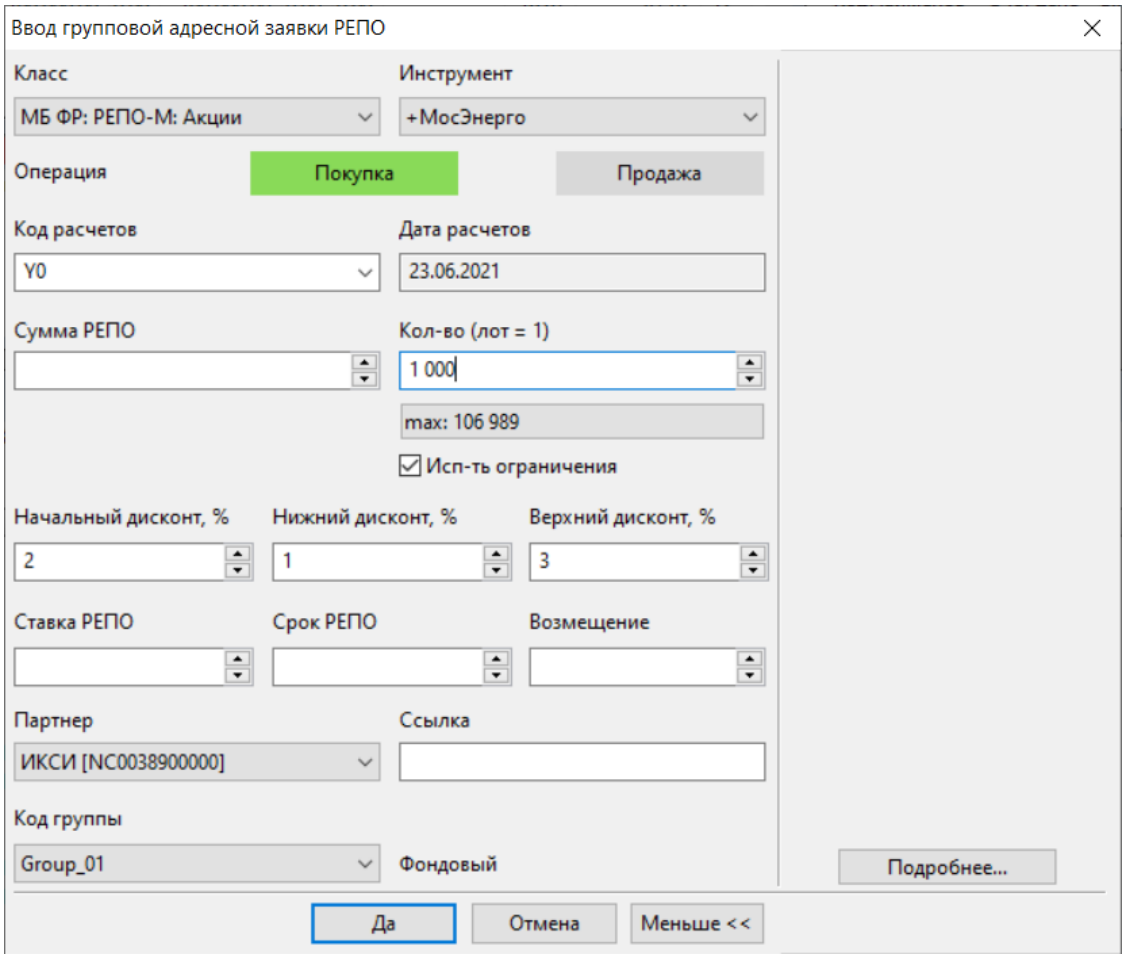
Групповая адресная заявка РЕПО представляет собой поручение на создание пакета адресных заявок РЕПО-М или РЕПО с ЦК по счетам группы клиентов.

6.9.1 Ввод групповой адресной заявки РЕПО

Открыть окно создания групповой заявки можно одним из следующих способов:

- Выбором в меню программы пункта **Расширения / TrustManager / Подать групповую адресную заявку РЕПО...**;
- Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая адресная заявка РЕПО» в таблицах модуля, относящихся к адресным заявкам РЕПО. Таблица при этом не должна быть пустой.
- Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая адресная заявка РЕПО» в таблицах Рабочего места QUIK: Таблица текущих торгов, Таблица заявок на внебиржевые сделки, Таблица сделок.

В окне доступны параметры:



1. «Класс» – класс, к которому относится инструмент. После выбора класса становятся доступными список инструментов и коды группы.
2. «Инструмент» – наименование инструмента.
3. «Операция» – направление операции: «Покупка» или «Продажа».
4. «Код расчетов».
5. «Дата расчетов» – дата расчетов по сделке для указанного инструмента и кода расчетов (информационное поле).
6. «Сумма РЕПО» – объем сделки РЕПО в денежном выражении.

7. «Кол-во» – объем заявки в лотах. В поле «max» отображается максимально возможный объем заявки выбранной направленности (на покупку либо на продажу). На величину максимального объема влияют изменение суммы РЕПО и условие «Использовать ограничения».

   - «Исп-ть ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.

8. «Начальный дисконт, %» – условие сделки РЕПО-М, выражается в процентах, указывается в заявке на заключение сделки РЕПО-М в явном виде или однозначно определяется из условий заявки. Доступно только для классов типа РЕПО-М.
9. «Нижний дисконт, %» – условие сделки РЕПО-М, выражается в процентах. Если дисконт становится меньше нижнего предельного значения дисконта, у первоначального продавца возникает обязательство по внесению компенсационного взноса в денежной форме. Доступно только для классов типа РЕПО-М.
10. «Верхний дисконт, %» – условие сделки РЕПО-М, выражается в процентах. При превышении дисконтом величины верхнего предельного значения дисконта у первоначального покупателя возникает обязательство по внесению компенсационного взноса облигациями. Доступно только для классов типа РЕПО-М.
11. «Дисконт» – условие сделки РЕПО с ЦК, выражается в процентах, указывается в заявке на заключение сделки РЕПО с ЦК в явном виде или однозначно определяется из условий заявки. Доступно только для классов типа РЕПО с ЦК.
12. «Ставка РЕПО» – ставка платы за пользование ресурсами, в процентах годовых.
13. «Срок РЕПО» – промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно.
14. «Возмещение» – денежные средства, перечисляемые одним из контрагентов по сделке другому, в случае просрочки исполнения своих обязательств по сделке. Задается в процентах от суммы сделки. Доступно только для классов типа РЕПО-М.
15. «Партнер» – выберите из списка код участника торгов, являющегося партнером по сделке.
16. «Ссылка» – текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Текстовая строка может состоять из любого сочетания букв и цифр и иметь длину не более 10 символов.
17. «Код группы» – код группы клиентов. После выбора инструмента и кода группы в заявке отображаются максимальные значения объема заявки. Справа от поля справочно отображается тип рынка выбранной группы, например, «Фондовый».
18. Кнопка «Подробнее»— просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Ввод заявки завершается нажатием кнопки «Да». Нажатие кнопки «Отмена» отменяет ввод заявки и закрывает окно.

6.9.2 Ввод групповой адресной заявки РЕПО на основании существующей

На основании уже существующей групповой адресной заявки РЕПО можно подать новую заявку, все параметры которой будут совпадать с параметрами исходной групповой заявки. При этом изменить можно только направление заявки.

Окно ввода копируемой заявки открывается выбором пункта контекстного меню «Повторить адресную заявку РЕПО» в таблице «Групповые адресные внебиржевые заявки».

6.9.3 Снятие групповой адресной заявки РЕПО

Неисполненные групповые адресные заявки РЕПО можно отменить.

Для снятия заявки выберите в таблице «Групповые адресные внебиржевые заявки» строку с этой заявкой и выполните ее отмену одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «Ctrl»+«D»;
- Выбором пункта контекстного меню «Снять групповую адресную заявку РЕПО».

Результат снятия групповой заявки отображается в «Окне сообщений».

6.10 Таблица «Групповые адресные внебиржевые заявки»

меню **Расширения / TrustManager / Групповые адресные внебиржевые заявки...**

6.10.1 Назначение

Таблица «Групповые адресные внебиржевые заявки» предназначена для просмотра состояния исполнения групповых адресных заявок, а также заявок РЕПО. В таблице отображаются все групповые адресные внебиржевые заявки, созданные пользователем программы TrustManager.

6.10.2 Формат таблицы

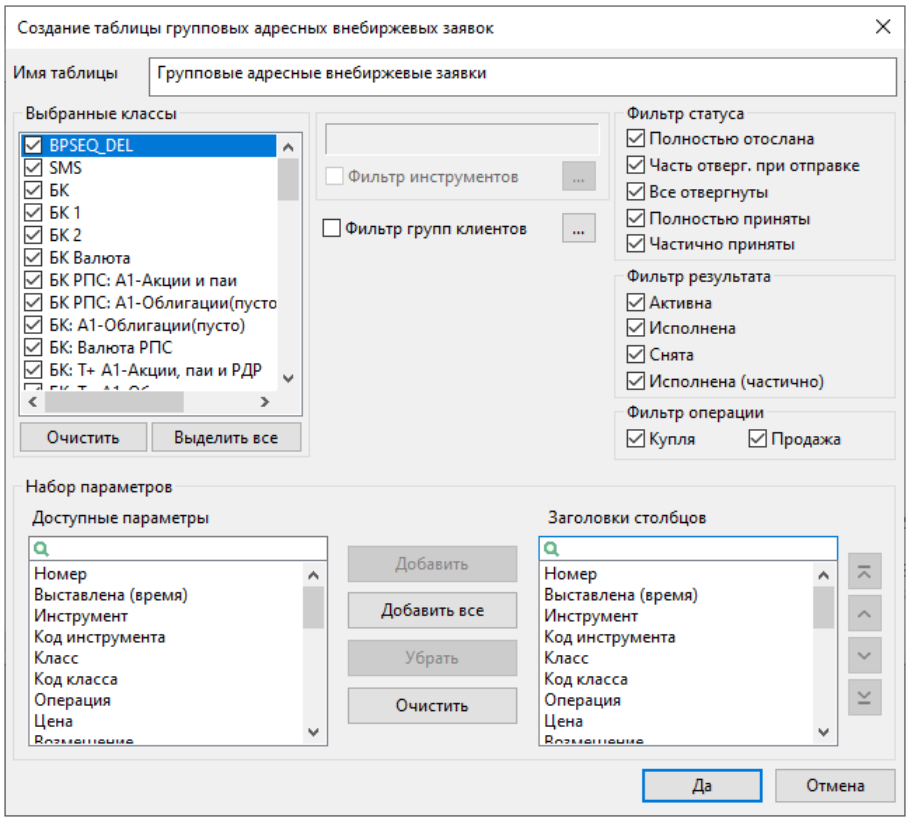
Каждая строка таблицы содержит информацию об отдельной групповой адресной заявке или заявке РЕПО. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Номер групповой заявки в базе данных (заявки нумеруются начиная с «0»)
Выставлена (время)	Время регистрации групповой заявки
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе биржи

Заголовок	Назначение
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Возмещение	Ставка возмещения в случае отказа от исполнения либо просрочки исполнения своих обязательств по сделке, в % годовых
Кол-во	Количество лотов, указанное в групповой заявке
Выставлено	Суммарное количество лотов в сформированных индивидуальных заявках
Снято, отвергнуто	Количество лотов в заявках, которые не попали в торговую систему или были отозваны самим пользователем
Партнер	Идентификатор участника торгов, которому адресована заявка
Код расчетов	Код расчетов по сделке
Ссылка	Текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке
Код группы	Код группы клиентов, по счетам которых подана групповая заявка
Статус	Результат постановки заявок в торговую систему. Возможные значения: _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Отослана (частично)» – производится передача заявок в торговую систему; _ «Отослана» – передача заявок в торговую систему завершена; _ «Принята (частично)» – заявки приняты торговой системой частично, т.е. часть имеет статус «Активна», а часть – другие статусы; _ «Полностью приняты» – все заявки приняты торговой системой; _ «Отвергнута» – все заявки отвергнуты торговой системой либо сервером QUIK
Результат	Результат исполнения заявок в торговой системе. Возможные значения: _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Активна» – заявки приняты торговой системой, но не исполнены; _ «Исполнена (частично)» – часть заявок имеют статус «Исполнена»; _ «Исполнена» – все заявки имеют статус «Исполнена»; _ «Снята» – заявки отозваны пользователем
Сумма РЕПО	Сумма РЕПО, указанная при вводе заявки
Сумма РЕПО (выставлено)	Фактическая сумма РЕПО по поданным заявкам
Дисконт	Дисконт (для РЕПО-М: начальный дисконт)

Заголовок	Назначение
Верхний дисконт	Верхний дисконт. При превышении дисконтом величины верхнего предельного значения дисконта у первоначального покупателя возникает обязательство по внесению компенсационного взноса облигациями. Доступно только для классов типа РЕПО-М
Нижний дисконт	Нижний дисконт. Если дисконт становится меньше нижнего предельного значения дисконта, у первоначального продавца возникает обязательство по внесению компенсационного взноса в денежной форме. Доступно только для классов типа РЕПО-М
Ставка РЕПО	Ставка платы за пользование ресурсами, в процентах годовых
Срок РЕПО	Промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно

6.10.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Выбранные классы» – фильтр значений таблицы по полю «Код класса». Символом ☑ отмечены выбранные классы. Нажатием кнопки «Очистить» сбрасываются отметки по всему списку. Нажатием кнопки «Выделить все» выбираются все классы из списка.

3. «Фильтр инструментов» – фильтр значений таблицы по полю «Инструмент». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные инструменты».
4. «Фильтр групп клиентов» – фильтр значений таблицы по полю «Код группы». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные». Окно «Поиск» ниже списка кодов предназначено для поиска значений в списке. Фильтр имеет дополнительные параметры настройки:

   - «Включать в список выбранные» – в таблице будут отображены коды групп, перечисленные в списке «Выбранные».
   - «Исключать из списка выбранные» – в таблице будут отображены все коды групп, за исключением перечисленных в списке «Выбранные».
   - «Фильтровать по префиксу» – если признак выключен, то фильтр распространяется на точные совпадения значений с указанными в списке «Выбранные»; если признак включен, то фильтр распространяется на все значения, начинающиеся с указанных в фильтре комбинаций символов.
5. «Фильтры статуса» – фильтр значений таблицы по полю «Статус». Отметьте флажками статусы, требуемые для отображения.
6. «Фильтр результата» – фильтр значений таблицы по полю «Результат». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
7. «Фильтр операции» – фильтр значений таблицы по направлению операции: «Купля» или «Продажа». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
8. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

Нажмите кнопку «Да», чтобы принять изменения. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования закроется без сохранения изменений.

6.10.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы для групповых адресных заявок доступны следующие функции:

- «Показать адресные заявки» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Адресные заявки по групповой адресной заявке [ ]» со списком индивидуальных адресных заявок, сформированных на основании данной групповой заявки.
- «Новая групповая адресная заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой адресной заявки.
- «Заменить групповую адресную заявку» (или «Ctrl»+«A») – заменить выбранную активную (неисполненную) групповую адресную заявку.
- «Снять групповую адресную заявку» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) групповую адресную заявку.
- «Повторить групповую адресную заявку» – ввести новую групповую адресную заявку с условиями, аналогичными выбранной заявке.

В контекстном меню таблицы для групповых адресных заявок РЕПО доступны следующие функции:

- «Показать адресные заявки РЕПО» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Адресные внебиржевые заявки РЕПО по групповой адресной заявке РЕПО [ ]» со списком индивидуальных адресных заявок РЕПО, сформированных на основании данной групповой заявки РЕПО.
- «Новая групповая адресная заявка РЕПО» (или «F2») – открыть окно ввода групповой адресной заявки РЕПО.
- «Заменить групповую адресную заявку РЕПО» (или «Ctrl»+«A») – заменить выбранную активную (неисполненную) групповую адресную заявку РЕПО.
- «Снять групповую адресную заявку РЕПО» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) групповую адресную заявку РЕПО.
- «Повторить групповую адресную заявку РЕПО» – ввести новую групповую адресную заявку РЕПО с условиями, аналогичными выбранной заявке.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.11 Таблица «Адресные заявки по групповой адресной заявке [ ]»

6.11.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных адресных заявок по счетам клиентов, сформированных на основе одной групповой адресной заявки, номер которой указан в заголовке таблицы. Для просмотра состояния индивидуальных заявок, созданных на основе нескольких групповых заявок, используйте Таблицу заявок на внебиржевые сделки.

Таблицу можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Групповые адресные внебиржевые заявки» или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать адресные заявки».

6.11.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельной заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Регистрационный номер заявки в торговой системе биржи. Если заявка не попала в торговую систему, то она не имеет номера, и вместо него отображается знак «?»
Выставлена (время)	Время регистрации заявки в торговой системе

Заголовок	Назначение
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Возмещение	Ставка возмещения в случае отказа от исполнения сделки, в % годовых
Кол-во	Количество инструментов в заявке, в лотах
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Торговый счет	Номер торгового счета, на котором отражаются операции клиента по данному инструменту
Партнер	Идентификатор участника торгов, которому адресована заявка
Код расчетов	Код расчетов по сделке
Ссылка	Текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке
Статус	Состояние передачи заявки в торговую систему
Результат	Состояние исполнения заявки («Активна», «Исполнена», «Снята»)
Идентификатор	Ключ для экспорта по ODBC
Сумма РЕПО	Сумма РЕПО, указанная при вводе заявки
Сумма РЕПО (выставлено)	Фактическая сумма РЕПО по поданным заявкам
Дисконт	Дисконт (для РЕПО-М: начальный дисконт)
Верхний дисконт	Верхний дисконт. При превышении дисконтом величины верхнего предельного значения дисконта у первоначального покупателя возникает обязательство по внесению компенсационного взноса облигациями. Доступно только для классов типа РЕПО-М
Нижний дисконт	Нижний дисконт. Если дисконт становится меньше нижнего предельного значения дисконта, у первоначального продавца возникает обязательство по внесению компенсационного взноса в денежной форме. Доступно только для классов типа РЕПО-М
Ставка РЕПО	Ставка платы за пользование ресурсами, в процентах годовых

Заголовок	Назначение
Срок РЕПО	Промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно

6.11.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.11.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для экспорта через DDE-сервер.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая адресная заявка» (или «F2») – открыть окно ввода групповой адресной заявки.
- «Снять адресную заявку» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) адресную заявку.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.12 Таблица «Адресные внебиржевые заявки РЕПО по групповой адресной заявке РЕПО [ ]»

6.12.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных адресных заявок РЕПО по счетам клиентов, сформированных на основе одной групповой адресной заявки РЕПО, номер которой указан в заголовке таблицы. Для просмотра состояния индивидуальных заявок, созданных на основе нескольких групповых заявок, используйте Таблицу заявок на внебиржевые сделки.

Таблицу можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Групповые адресные внебиржевые заявки», соответствующей заявке РЕПО, или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать адресные заявки РЕПО».

6.12.2 Формат таблицы

Формат таблицы аналогичен формату таблицы «Адресные заявки по групповой адресной заявке [ ]» (подробнее см. п. 6.11.2).

6.12.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.12.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая адресная заявка РЕПО» (или «F2») – открыть окно ввода групповой адресной заявки РЕПО.
- «Снять адресную заявку РЕПО» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) адресную заявку РЕПО.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

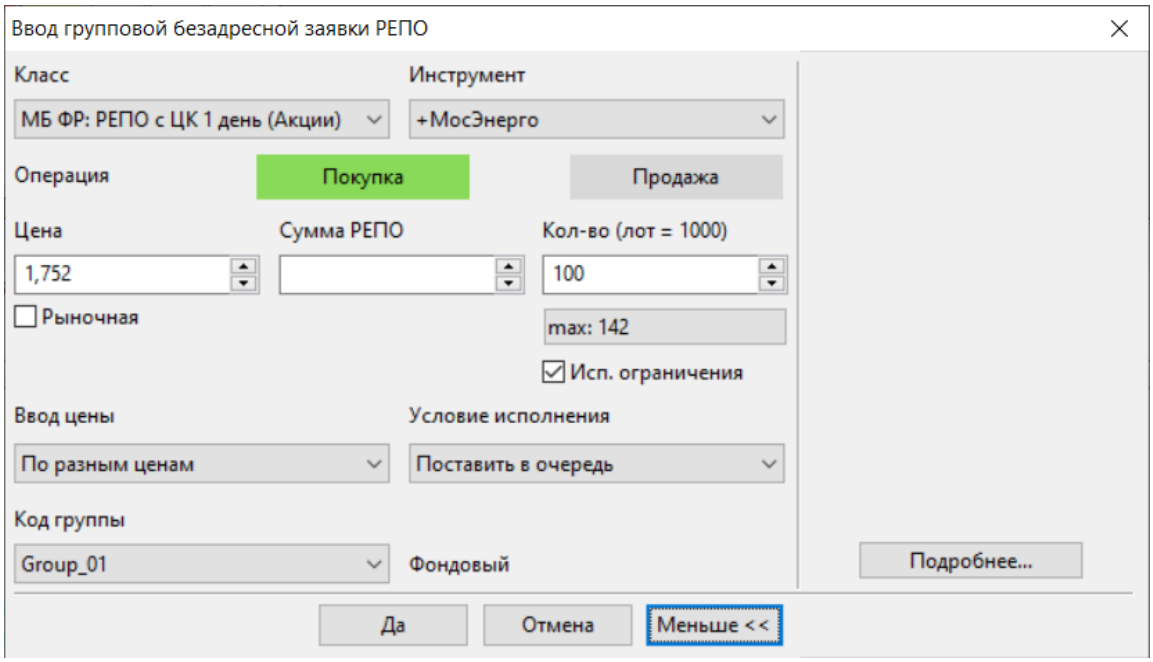
6.13 Операции с групповыми безадресными заявками РЕПО

Групповая безадресная заявка РЕПО представляет собой поручение на создание пакета безадресных заявок РЕПО с ЦК по счетам группы клиентов.

6.13.1 Ввод групповой безадресной заявки РЕПО

1. Выбором в меню программы пункта **Расширения / TrustManager / Подать групповую безадресную заявку РЕПО…**;
2. Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» в таблицах модуля, относящихся к безадресным заявкам РЕПО. Таблица при этом не должна быть пустой.
3. Выбором пункта контекстного меню «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» в таблицах Рабочего места QUIK: Таблица текущих торгов, Таблица заявок на внебиржевые сделки, Таблица сделок, Таблицы заявок.

В окне доступны параметры:



1. «Класс» – класс, к которому относится инструмент. После выбора класса становятся доступными список инструментов и коды группы.
2. «Инструмент» – наименование инструмента.
3. «Операция» – направление операции: «Покупка» или «Продажа».
4. «Цена» – цена заявки за единицу инструмента.

   - «Рыночная» – признак исполнения заявки по рыночной цене.
5. «Сумма РЕПО» – объем сделки РЕПО в денежном выражении.
6. «Кол-во» – объем заявки в лотах. В поле «max» отображается максимально возможный объем заявки выбранной направленности (на покупку либо на продажу). На величину максимального объема влияют изменение суммы РЕПО и условие «Использовать ограничения».

   - «Исп-ть ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
7. «Ввод цены» – цена исполнения заявки:

   - «По одной цене» – заявка исполняется по одной цене.
   - «По разным ценам» – заявка может быть исполнена по разным ценам.
8. «Условие исполнения» – порядок обработки остатка заявки при ее частичном исполнении:

   - «Полностью или отклонить» – заявка исполняется только полностью, т.е. при наличии в торговой системе встречных заявок по цене, не хуже указанной и с количеством инструментов, превышающим объем заявки.
   - «Поставить в очередь» – неисполненный остаток ставится в очередь с ценой, указанной в заявке. Если заявка рыночная, и встречные заявки отсутствуют, то неисполненный остаток снимается с торгов.

- «Снять остаток» – неисполненный остаток снимается с торгов.

По умолчанию заявка имеет условие «Поставить в очередь».

9. «Код группы» – код группы клиентов. После выбора инструмента и кода группы в заявке отображаются максимальные значения объема заявки. Справа от поля справочно отображается тип рынка выбранной группы, например, «Фондовый».
10. Кнопка «Подробнее» — просмотр распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам, отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Ввод заявки завершается нажатием кнопки «Да». Нажатие кнопки «Отмена» отменяет ввод заявки и закрывает окно.

6.13.2 Ввод групповой безадресной заявки РЕПО на основании существующей

На основании уже существующей групповой безадресной заявки РЕПО можно подать новую заявку, все параметры которой будут совпадать с параметрами исходной групповой заявки. При этом изменить можно только направление заявки.

Окно ввода копируемой заявки открывается выбором пункта контекстного меню «Повторить безадресную заявку РЕПО» в таблице «Групповые безадресные внебиржевые заявки».

6.13.3 Снятие групповой безадресной заявки РЕПО

Неисполненные групповые безадресные заявки РЕПО можно отменить.

Для снятия заявки выберите в таблице «Групповые безадресные внебиржевые заявки» строку с этой заявкой и выполните ее отмену одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «Ctrl»+«D»;
- Выбором пункта контекстного меню «Снять групповую безадресную заявку РЕПО».

Результат снятия групповой заявки отображается в «Окне сообщений».

6.14 Таблица «Групповые безадресные внебиржевые заявки»

меню **Расширения / TrustManager / Групповые безадресные внебиржевые заявки…**

6.14.1 Назначение

Таблица «Групповые безадресные внебиржевые заявки» предназначена для просмотра состояния исполнения групповых безадресных заявок РЕПО с ЦК. В таблице отображаются

все групповые безадресные внебиржевые заявки РЕПО с ЦК, созданные пользователем программы TrustManager.

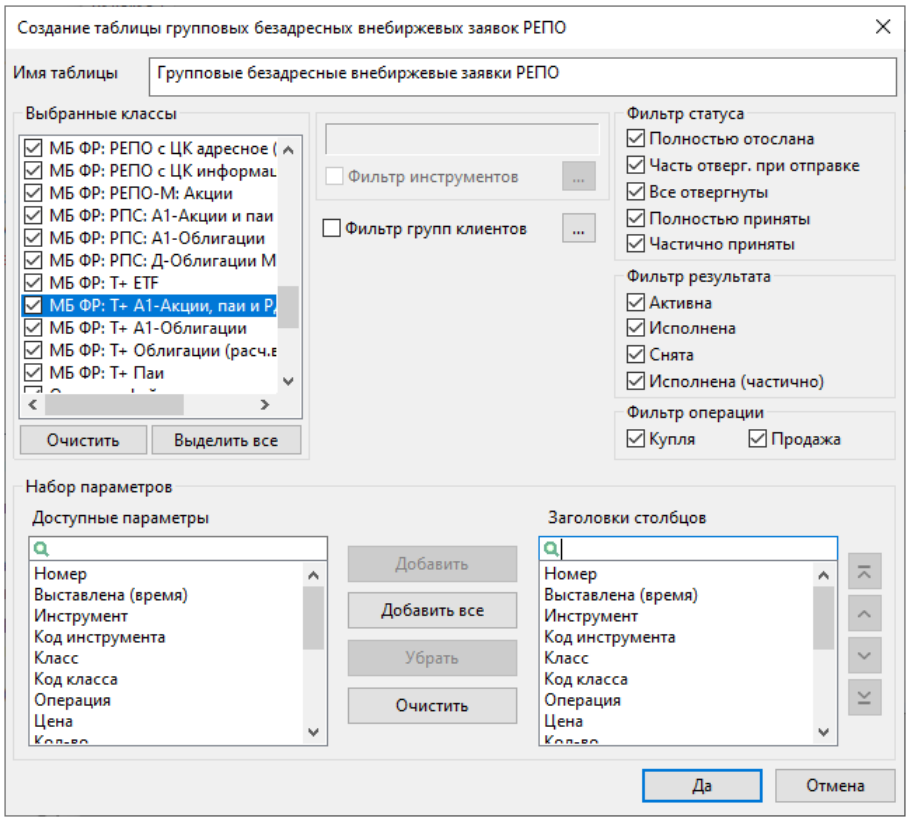
6.14.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы содержит информацию об отдельной групповой безадресной заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Номер групповой заявки в базе данных (заявки нумеруются начиная с «0»)
Выставлена (время)	Время регистрации групповой заявки
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе биржи
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Кол-во	Количество лотов в групповой заявке
Выставлено	Суммарное количество лотов в сформированных индивидуальных заявках
Снято, отвергнуто	Количество лотов в заявках, которые не попали в торговую систему или были отозваны самим пользователем
Сумма РЕПО	Сумма РЕПО, указанная при вводе заявки
Сумма РЕПО (выставлено)	Фактическая сумма РЕПО по введенным заявкам
Дисконт	Размер дисконта. Для рыночных заявок размер дисконта РЕПО на момент подачи групповой заявки.
Код группы	Код группы клиентов, по счетам которых подана групповая заявка
Статус	Результат постановки заявок в торговую систему. Возможные значения: – «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; – «Отослана (частично)» – производится передача заявок в торговую систему; – «Отослана» – передача заявок в торговую систему завершена; – «Принята (частично)» – заявки приняты торговой системой частично, т.е. часть имеет статус «Активна», а часть – другие статусы; – «Полностью приняты» – все заявки приняты торговой системой; – «Отвергнута» – все заявки отвергнуты торговой системой либо сервером QUIK

Заголовок	Назначение
Результат	Результат исполнения заявок в торговой системе. Возможные значения: _ «Подаётся» – производится формирование индивидуальных заявок; _ «Активна» – заявки приняты торговой системой, но не исполнены; _ «Исполнена (частично)» – часть заявок имеют статус «Исполнена»; _ «Исполнена» – все заявки имеют статус «Исполнена»; _ «Снята» – заявки отозваны пользователем

6.14.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Выбранные классы» – фильтр значений таблицы по полю «Код класса». Символом ☑ отмечены выбранные классы. Нажатием кнопки «Очистить» сбрасываются отметки по всему списку. Нажатием кнопки «Выделить все» выбираются все классы из списка.
3. «Фильтр инструментов» – фильтр значений таблицы по полю «Инструмент». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные инструменты».
4. «Фильтр групп клиентов» – фильтр значений таблицы по полю «Код группы». Для настройки фильтра нажмите кнопку «…». В открывшемся окне настройте список «Выбранные». Окно «Поиск» ниже списка кодов предназначено для поиска значений в списке. Фильтр имеет дополнительные параметры настройки:

- «Включать в список выбранные» – в таблице будут отображены коды групп, перечисленные в списке «Выбранные».
- «Исключать из списка выбранные» – в таблице будут отображены все коды групп, за исключением перечисленных в списке «Выбранные».
- «Фильтровать по префиксу» – если признак выключен, то фильтр распространяется на точные совпадения значений с указанными в списке «Выбранные»; если признак включен, то фильтр распространяется на все значения, начинающиеся с указанных в фильтре комбинаций символов.

5. «Фильтры статуса» – фильтр значений таблицы по полю «Статус». Отметьте флажками статусы, требуемые для отображения.
6. «Фильтр результата» – фильтр значений таблицы по полю «Результат». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
7. «Фильтр операции» – фильтр значений таблицы по направлению операции: «Купля» или «Продажа». Отметьте флажками значения, требуемые для отображения.
8. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

Нажмите кнопку «Да», чтобы принять изменения. Нажатием кнопки «Отмена» окно редактирования закроется без сохранения изменений.

6.14.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Показать безадресные заявки РЕПО» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открыть таблицу «Безадресные заявки по групповой безадресной заявке [ ]» со списком индивидуальных безадресных заявок, сформированных на основании данной групповой заявки. Формат таблицы аналогичен формату таблицы «Групповые безадресные внебиржевые заявки».
- «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» (или «F2») – открыть окно ввода новой групповой безадресной заявки РЕПО.
- «Снять групповую безадресную заявку РЕПО» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) групповую безадресную заявку РЕПО.
- «Повторить групповую безадресную заявку РЕПО» – ввести новую групповую безадресную заявку РЕПО с условиями, аналогичными выбранной заявке.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.15 Таблица «Безадресные внебиржевые заявки РЕПО по групповой безадресной заявке РЕПО [ ]»

6.15.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных безадресных заявок РЕПО по счетам клиентов, сформированных на основе одной групповой безадресной заявки РЕПО, номер которой указан в заголовке таблицы. Для просмотра состояния индивидуальных заявок, созданных на основе нескольких групповых заявок, используйте Таблицу заявок.

Таблицу можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Групповые безадресные внебиржевые заявки», соответствующей заявке РЕПО, или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать безадресные заявки РЕПО».

6.15.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельной заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Регистрационный номер заявки в торговой системе биржи. Если заявка не попала в торговую систему, то она не имеет номера, и вместо него отображается знак «?»
Выставлена (время)	Время регистрации заявки в торговой системе
Инструмент	Наименование инструмента
Код инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Кол-во	Количество инструментов в заявке, в лотах
Выставлено	Суммарное количество лотов в сформированных индивидуальных заявках
Снято, отвергнуто	Количество лотов в заявках, которые не попали в торговую систему или были отозваны самим пользователем
Сумма РЕПО	Сумма РЕПО, указанная при вводе заявки
Сумма РЕПО (выставлено)	Фактическая сумма РЕПО по поданным заявкам
Код расчетов	Код расчетов по сделке

Заголовок	Назначение
Срок РЕПО	Промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно
Дисконт	Дисконт (для РЕПО-М: начальный дисконт)
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Торговый счет	Номер торгового счета, на котором отражаются операции клиента по данному инструменту
Статус	Состояние передачи заявки в торговую систему
Результат	Состояние исполнения заявки («Активна», «Исполнена», «Снята»)

6.15.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.15.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступны следующие функции:

- «Новая групповая безадресная заявка РЕПО» (или «F2») – открыть окно ввода новой групповой безадресной заявки РЕПО.
- «Снять безадресную заявку РЕПО» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – удалить выбранную активную (неисполненную) групповую безадресную заявку РЕПО.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.16 Пулы заявок

меню **Расширения / TrustManager / Пулы заявок...**

6.16.1 Применение пула заявок

Пулы заявок представляют собой групповые заявки, предназначенные для импорта в TrustManager из файла специального формата. Пул может включать в себя индивидуальные заявки с различными параметрами (разными направлениями операций, разными ценами, разными инструментами).

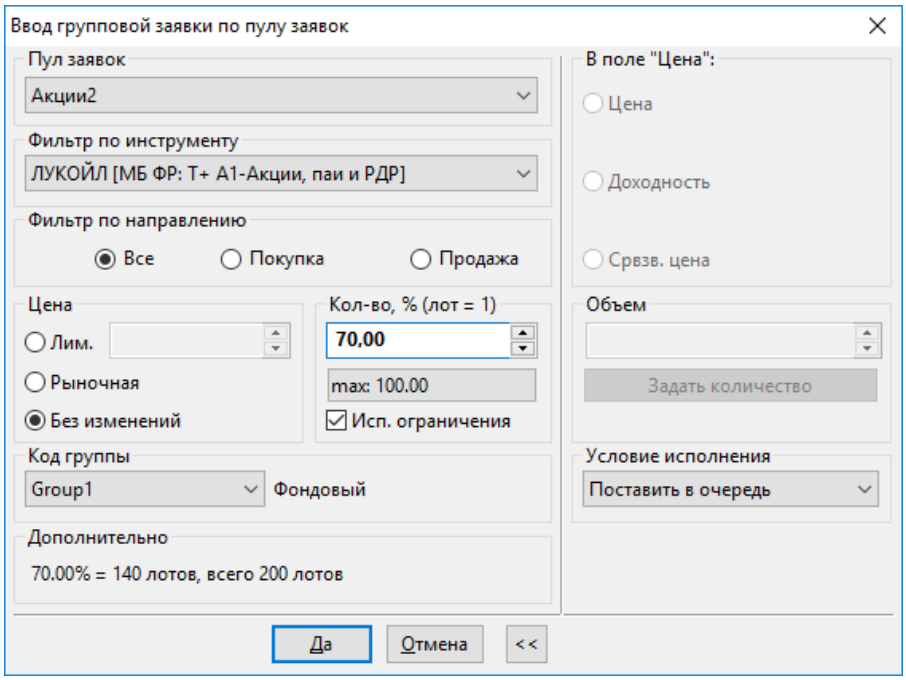
Пул с заявками импортируется из текстового файла специального формата. В настройках импорта пула заявок (меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Импорт данных» / «Пулы заявок») указывается директория с файлами пулов, из которой с указанным интервалом времени или по запросу пользователя производится импорт пулов в программу. Результат импорта пулов отражается в текстовом файле специального формата. Описание форматов файлов см. в п. 10.8.

Импортированный в программу пул с заявками можно выставлять в торговую систему сразу в полном объеме либо по частям в несколько приёмов. Кроме того, имеется возможность изменить некоторые параметры заявок в пуле (например, из лимитированных сделать рыночные, вместо покупки – продажу и наоборот).

6.16.2 Ввод заявки по пулу

Ввод групповой заявки по пулу заявок осуществляется выбором в таблице «Пулы заявок» пункта контекстного меню «Новая заявка по пулу». Имеется возможность фильтрации заявок из пула по инструментам, по направлению операций для отправки в торговую систему. Пользователь может выставить как полностью все заявки из пула, так и часть заявок.

Значения параметров заявки по пулу:



1. «Пул заявок» – наименование пула, из которого выставляется заявка. Список содержит перечень всех пулов из таблицы.
2. «Фильтр по инструменту» – инструмент, заявки по которому требуется выставить. Список содержит перечень инструментов, заявки по которым содержатся в выбранном пуле.
3. «Фильтр по направлению» – направление операций в заявках для выставления в торговую систему («Всё», «Покупка», «Продажа»).
4. «Цена» – возможность изменения цены инструмента в групповой заявке. Возможные значения: «Лим.» – лимитированная, «Рыночная», «Без изменений».

5. «Кол-во, %» – процент количества инструментов в выставляемых заявках от доступного количества.
6. «max» – максимально возможный объем заявки выбранной направленности.
7. «Исп. ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
8. «Код группы» – код группы клиентов. Справа от списка отображается тип рынка для выбранной группы, например, «Фондовый».
9. В поле «Дополнительно» отображается расчет количества инструментов в выставляемых заявках и суммарного количества инструментов в заявках, отфильтрованных по инструменту и направлению операции, выставленных от клиентов, входящих в указанную группу (параметр «Всего»).

6.16.3 Снятие пула заявок

Неисполненные пулы заявок можно отменить, выбрав пункт контекстного меню «Снять пул заявок». Статус соответствующего пула в результате примет значение «Снят».

6.17 Таблица «Пулы заявок»

меню **Расширения / TrustManager / Пулы заявок...**

6.17.1 Назначение

Таблица отображает пулы заявок, успешно загруженные из файла. По каждому пулу можно посмотреть список входящих в него заявок, открыв таблицу «Заявки в пуле [ ]» двойным нажатием левой кнопки мыши.

6.17.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному пулу. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Номер пула
ID пула	Уникальный идентификационный код пула
Наименование пула	Наименование пула заявок
Время создания	Время регистрации групповой заявки
Всего	Общее количество лотов, указанное в пуле
Отправлено	Суммарное количество лотов в отправленных в торговую систему заявках пула
Исполнено	Суммарное количество лотов в исполненных заявках пула

Заголовок	Назначение
Акт. кол-во	Суммарное количество лотов в активных (неисполненных) индивидуальных заявках пула
Снято, отвергнуто	Количество лотов в заявках, которые не попали в торговую систему или были отозваны самим пользователем
Статус	Результат отправки заявок в торговую систему

6.17.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.17.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Операции, доступные из контекстного меню:

- «Показать заявки» (или двойное нажатие левой кнопкой мыши на строке таблицы) – открытие таблицы «Заявки в пуле [ ]» со списком индивидуальных заявок, сформированных на основании данного пула заявок.
- «Новая заявка по пулу» (или «F2») – открыть окно ввода заявки по пулу.
- «Снять пул заявок» (или «Ctrl»+«D», или двойное нажатие правой кнопкой мыши на строке таблицы) – снятие выбранного активного (неисполненного) пула.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

6.18 Таблица «Заявки в пуле [ ]»

6.18.1 Назначение

Таблица отображает список индивидуальных заявок по счетам клиентов, сформированных на основе одного пула заявок, номер которого указан в заголовке таблицы.

Таблицу можно открыть двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Пулы заявок» или выбором в ней пункта контекстного меню «Показать заявки».

6.18.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельной заявке. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Заголовок	Назначение
Номер	Регистрационный номер заявки в торговой системе биржи
Инструмент	Наименование инструмента
Код Инструмента	Идентификатор инструмента в торговой системе
Класс	Наименование класса инструмента в торговой системе
Код класса	Код класса инструмента
Операция	Направление операции: «Купля» либо «Продажа»
Цена	Цена за единицу инструмента
Кол-во	Количество инструментов в заявке, в лотах
Код клиента	Код, присвоенный клиенту брокером
Комментарий	Текстовый комментарий к заявке
Отправлено	Количество лотов заявки, отправленных в торговую систему
Исполнено	Количество исполненных лотов в заявке
Акт. кол-во	Неисполненное количество лотов заявки
Отвергнуто	Количество лотов заявки, отвергнутых торговой системой
Снято	Количество снятых лотов заявки

6.18.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

6.18.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

Операция, доступная из контекстного меню:

- «Новая заявка по пулу» (или «F2») – открыть окно ввода заявки по пулу.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

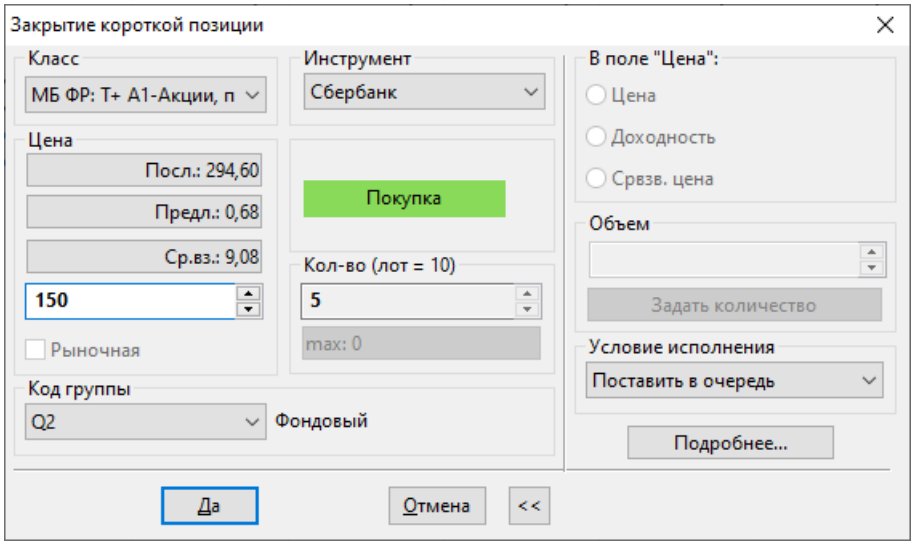
6.19 Специальные виды поручений

6.19.1 Закрытие короткой позиции

меню **Расширения / TrustManager / Закрыть короткую позицию…**

Поручение предназначено для закрытия коротких позиций, открытых на фондовом рынке.

В окне доступны параметры:



1. «Класс» – класс инструментов.
2. «Инструмент» – наименование инструмента.
3. «Цена» – цена заявки за единицу контракта. Цена указывается в нижнем поле. Выше него расположены три кнопки с информацией о ценах сделок, нажатием на которые отображаемое значение подставляется в поле цены:
   - «Посл.» – цена последней сделки по инструменту;
   - «Предл.» – лучшая цена предложения по инструменту;
   - «Ср. вз.» – средневзвешенная цена сделок по инструменту в текущей торговой сессии;
   - «рыночная» – признак исполнения заявки по рыночной цене (не доступен).
4. Направленность заявки для закрытия короткой позиции – «Покупка».
5. «Кол-во» – количество инструментов в заявке, соответствует величине короткой позиции. Значение не доступно для редактирования.
6. Кнопка «max» – максимально возможный объем заявки выбранной направленности (справочно, не доступно для действия).
7. «Код группы» – выберите группу клиентов, в отношении которых создается поручение. Справа от поля справочно отображается тип рынка для выбранной группы клиентов.
   - «Величина короткой позиции» – суммарное количество лотов в формируемой групповой заявке.

Применение полей в расширенной форме (правая панель, открываемая нажатием кнопки «>>») аналогично окну ввода заявки Рабочего места QUIK.

При нажатии на кнопку «Подробнее» открывается окно с таблицей просмотра распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам. Отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

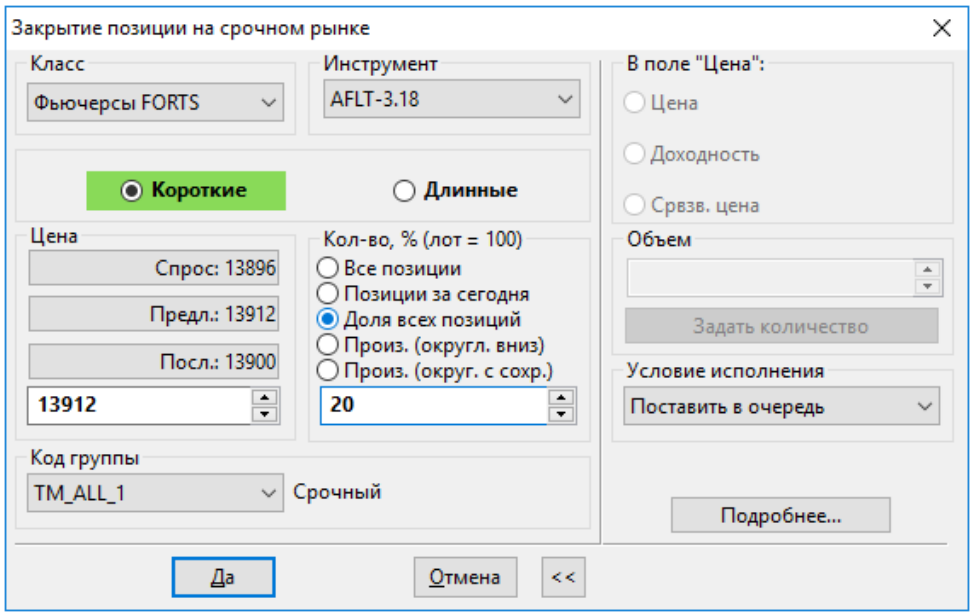
Ввод заявки завершается нажатием кнопки «Да» и в результате формируется групповая заявка, состояние которой можно наблюдать в таблице «Групповые заявки».

Данную групповую заявку можно снять либо заменить, используя стандартные функции работы с групповыми заявками.

6.19.2 Закрытие позиции на срочном рынке

меню **Расширения / TrustManager / Закрыть позицию на срочном рынке**

Поручение предназначено для закрытия либо сокращения открытых позиций на срочном рынке. Предусмотрена возможность полного закрытия позиции, понижения позиции на определенную величину в процентах либо в контрактах, а также раздельное управление длинными и короткими позициями.



В окне доступны параметры:

1. «Класс» – класс инструментов срочного рынка.
2. «Инструмент» – наименование срочного контракта.
3. Выберите тип позиции для закрытия – «длинные» либо «короткие»,
4. «Цена» – цена заявки. Цена указывается в нижнем поле. Выше него расположены три кнопки с информацией о ценах сделок, нажатием на которые отображаемое значение подставляется в поле цены:

   - «Спрос» – лучшая цена спроса по инструменту;
   - «Предл.» – лучшая цена предложения по инструменту;

- «Посл». – цена последней сделки по инструменту.

5. «Кол-во» – вариант снижения позиции:

   - «Все позиции» – формируется групповая заявка на закрытие всех открытых позиций по данному инструменту;
   - «Позиции за сегодня» – формируется групповая заявка на закрытие открытых позиций по данному инструменту, открытых в текущей торговой сессии;
   - «Доля всех позиций» – понижение величины открытых позиций на заданную величину, в процентах;
   - «Произ. (округл. вниз)» – понижение величины открытых позиций на заданную величину, выраженную в единицах контрактов;
   - «Произ. (округл. с сохр.)» – понижение величины открытых позиций на заданную величину, с сохранением суммарного количества.

   В нижнем поле указывается величина изменения позиции, кроме вариантов «Все позиции» и «Позиции за сегодня».

6. «Код группы» – выберите группу клиентов, в отношении которой производится изменение позиции. Справа от поля справочно отображается тип рынка для выбранной группы клиентов.

Применение полей в расширенной форме (правая панель, открываемая нажатием кнопки «>>») аналогично окну ввода заявки Рабочего места QUIK.

При нажатии на кнопку «Подробнее» открывается окно с таблицей просмотра распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам. Отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Ввод поручения завершается нажатием кнопки «Да». В результате формируется групповая заявка, состояние которой можно наблюдать в таблице «Групповые заявки».

Данную групповую заявку можно снять либо заменить, используя стандартные функции работы с групповыми заявками.

> **Для корректного закрытия позиций на срочном рынке у пользователя не должны присутствовать права на получение информации по классам FUTEVN и OPTEVN дополнительной сессии FORTS. Перечень доступных классов отображается в пункте меню Система/Заказ данных / Поток котировок… Рабочего места QUIK.**

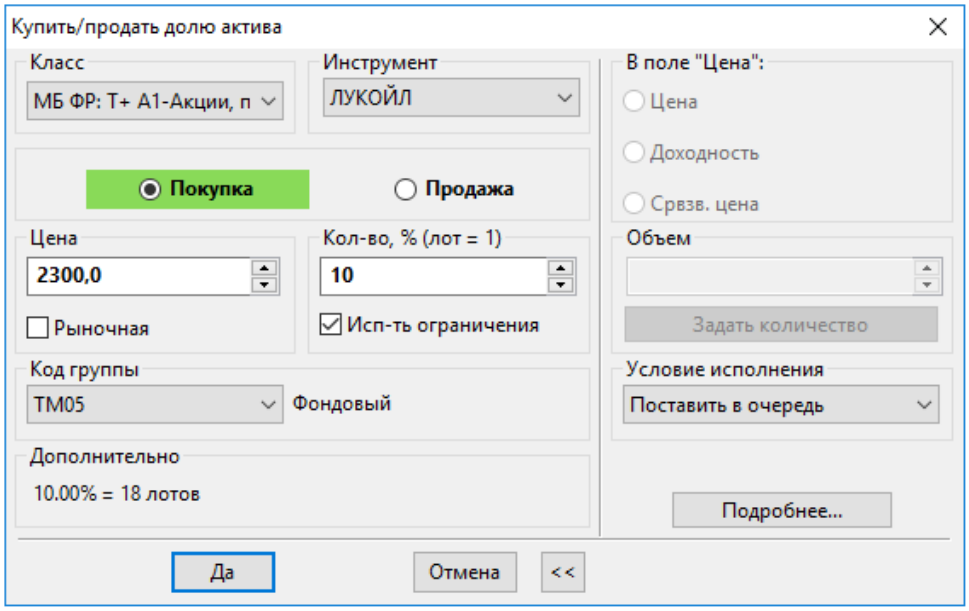
6.19.3 Покупка / продажа доли актива

меню **Расширения / TrustManager / Купить/продать долю актива…**

Поручение формирует заявку покупки / продажи доли актива в портфеле группы и может использоваться для закрытия длинных позиций на фондовом рынке.

Окно подачи поручения также можно открыть из следующих мест:

- из таблиц TrustManager: «Группы клиентов», «Активы по группе [ ]», «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])», «Информация по активам».
- из таблиц Рабочего места QUIK: «Текущие торги», «Котировки», «Таблица заявок», «Таблица стоп-заявок», «Таблица сделок».



В окне доступны параметры:

1. «Класс» – класс, к которому относится инструмент.
2. «Инструмент» – наименование инструмента из списка доступных.
3. Направление операции – «Покупка» или «Продажа».
4. «Цена» – цена заявки за единицу инструмента.

   - «Рыночная» – признак исполнения заявки по рыночной цене.
5. «Кол-во» – объем заявки в процентах от имеющегося (или доступного) количества актива каждого клиента группы.

   - «Исп-ть ограничения» – при исполнении групповой заявки соблюдать условия ограничений, относящихся к данной группе клиентов.
6. «Код группы» – группа клиентов, в отношении которой производится изменение позиции. Справа от поля справочно отображается тип рынка для выбранной группы клиентов.
7. «Дополнительно» – количество инструментов в выставляемых заявках исходя из заданного объема заявки в процентах.

Доли актива в заявках покупки и продажи определяются следующим образом:

- при покупке в заявке выставляется число процентов от максимально доступного объёма покупки данного актива по данной цене по каждому клиенту группы (при этом есть возможность как учитывать, так и не учитывать возможность кредитования клиента брокером);

- при продаже указывается число процентов от имеющегося количества актива у каждого клиента группы (при этом учитывается только величина собственных активов клиента).

Применение полей в расширенной форме (правая панель, открываемая нажатием кнопки «>>») аналогично окну ввода заявки Рабочего места QUIK.

При нажатии на кнопку «Подробнее» открывается окно с таблицей просмотра распределения количества групповой заявки по отдельным клиентам. Отображается как исходное количество по каждому клиенту, так и текущая покупательная способность, ограничения, влияющие на распределение количества и количество, которое получилось после всех проверок. Описание таблицы см. в п. 6.1.1.

Ввод поручения завершается нажатием кнопки «Да». В результате формируется групповая заявка, состояние которой можно наблюдать в таблице «Групповые заявки».

Данную групповую заявку можно снять либо заменить, используя стандартные функции работы с групповыми заявками.

7. Данные

7.1 Загруженные инструменты

меню **Расширения / TrustManager / Загруженные инструменты...**

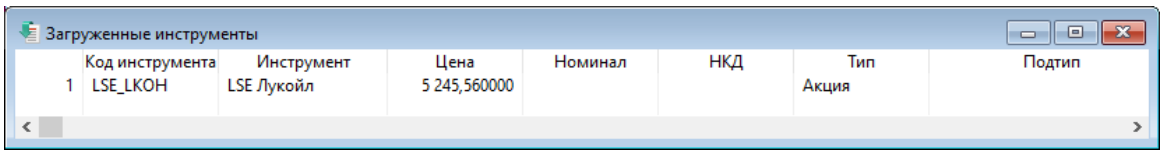
7.1.1 Назначение

Таблица предназначена для отображения информации о загруженных инструментах.

Описание формата данных приведено в пункте Импорт описаний инструментов и цен.

7.1.2 Формат таблицы

Каждая строка таблицы соответствует отдельному инструменту.



В столбцах отображаются параметры:

Заголовок	Назначение
Код инструмента	Код инструмента в торговой системе
Инструмент	Наименование инструмента

Заголовок	Назначение
Цена	Цена инструмента
Номинал	Номинальная стоимость облигации
НКД	Значение НКД для облигации
Тип *	Тип инструмента. Возможные значения: _ Акция; _ Облигация
Подтип	Полное описание типа инструмента

* – используется для разделения способа указания цены: в валюте/в процентах (для облигаций)

7.1.3 Параметры настройки таблицы

1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

7.1.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

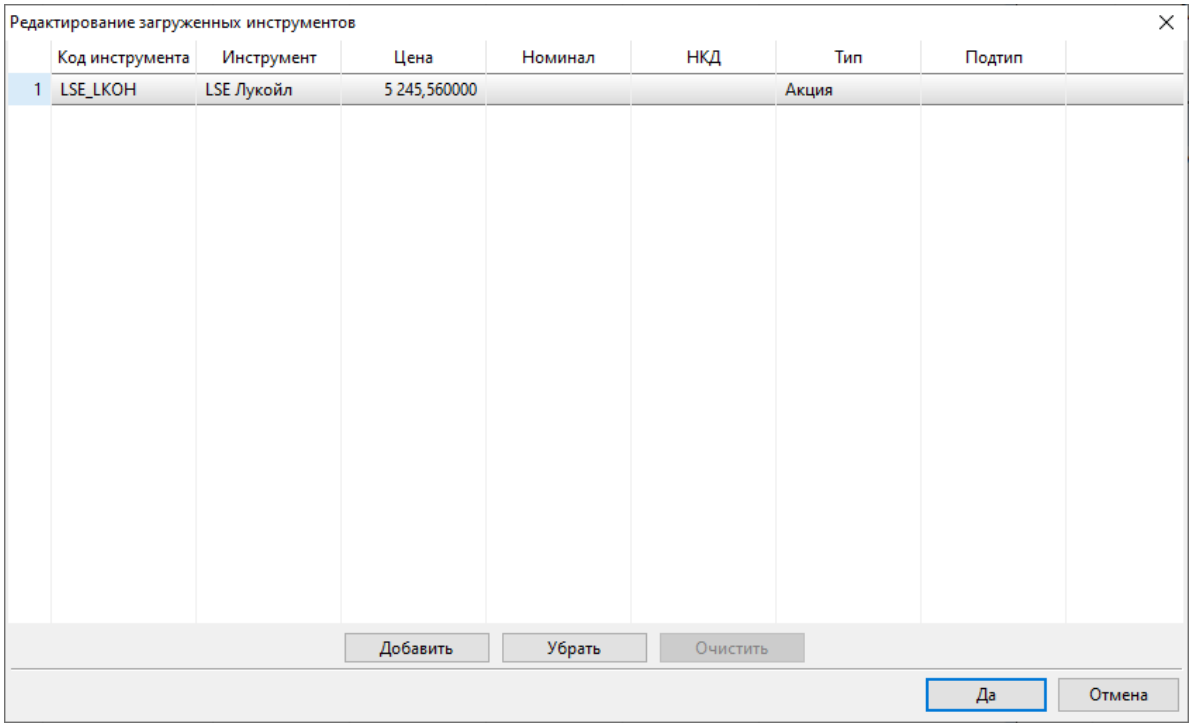
Операция, доступная из контекстного меню:

- «Редактировать инструменты» – задать параметры инструментов вручную.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

7.1.5 Редактирование инструментов

Для редактирования параметров инструментов в открывшемся диалоге выделите строку со значением инструмента и в нужных полях введите (выберите) новые значения.



1. Кнопка «Добавить» – добавить инструмент в таблицу «Загруженные инструменты». При нажатии на кнопку открывается форма ввода кода инструмента. После ввода кода в таблице отображается инструмент, данные по которому вводятся вручную. Значение поля «Код инструмента» изменению не подлежит.
2. Кнопка «Убрать» – удалить выбранный инструмент из таблицы.
3. Кнопка «Очистить» – очистить таблицу «Загруженные инструменты».

При нажатии на кнопку «Да», прежние значения параметров заменятся новыми значениями.

7.2 Загруженные позиции

меню **Расширения / TrustManager / Загруженные позиции…**

7.2.1 Назначение

Таблица предназначена для отображения информации о загруженных позициях клиентов. Описание форматов данных приведено в пунктах Импорт дополнительных позиций по инструментам и Импорт дополнительных денежных позиций.

7.2.2 Формат таблицы

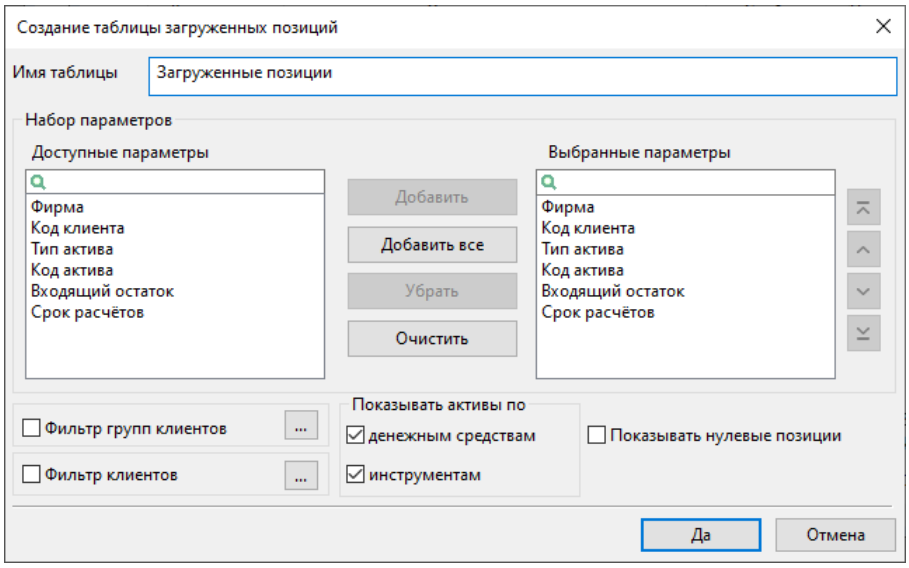
Каждая строка таблицы соответствует отдельной позиции клиента.

В столбцах таблицы отображаются параметры:

Заголовок	Назначение
Фирма	Идентификатор участника торгов

Заголовок	Назначение
Код клиента	Код клиента
Тип актива	Тип актива. Возможные значения: _ Инструменты; _ Деньги
Код актива	Код актива
Входящий остаток	Сумма собственных средств клиента до совершения операций
Срок расчётов	Срок расчетов

7.2.3 Параметры настройки таблицы



1. «Имя таблицы» – редактирование названия таблицы, принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.
3. «Фильтр групп клиентов» – фильтр групп кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента». Данный фильтр имеет приоритет над фильтром по клиентам.
4. «Фильтр клиентов» – фильтр кодов клиентов, отображаемых в столбце «Код клиента».
5. «Показывать активы по» – отображать в таблице активы по указанному типу.
   - «денежным средствам»;
   - «инструментам»
6. «Показывать нулевые позиции» – признак отображения позиций, у которых текущий остаток равен нулю.

7.2.4 Доступные функции

Данные таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

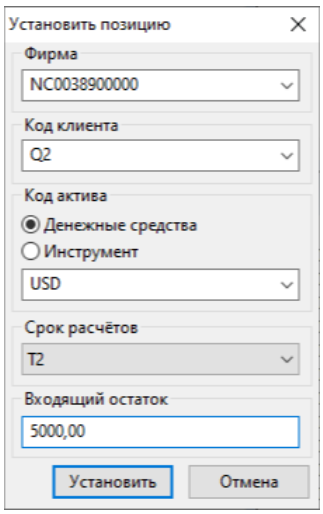
В контекстном меню таблицы доступны функции:

- «Задать позицию» – открыть форму «Установить позицию» по активу (см. п. 7.2.5).
- «Удалить позицию» – удалить выбранную позицию.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

7.2.5 Установить позицию

В открывшемся окне заполните следующие поля:



1. «Фирма» – идентификатор фирмы из списка.
2. «Код клиента» – код клиента из списка.
3. «Код актива».
4. «Входящий остаток».

Для установки позиции нажмите на кнопку «Установить». Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без установки позиции.

7.2.6 Редактировать позицию

Редактирование параметров загруженных позиций возможно следующими способами:

- выбором пункта контекстного меню «Установить позицию».
- двойным нажатием левой кнопки мыши на строке с выбранной позицией.

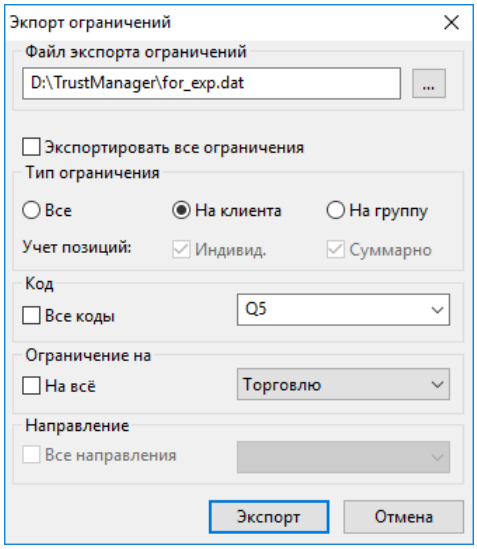
7.3 Экспорт ограничений

меню **Расширения / TrustManager / Экспорт ограничений...**

Экспорт ограничений в файл позволяет выгружать ограничения с разными условиями.

В файл выводятся ограничения, удовлетворяющие условиям, заданным в диалоге «Экспорт ограничений».

Формат данных аналогичен формату, применяемому при импорте ограничений (описание см. в. п. 10.5).



1. «Файл экспорта ограничений» – файл для экспорта через диалог.
2. «Экспортировать все ограничения» – по умолчанию флажок установлен и при этом прочие фильтры недоступны.
3. «Тип ограничения». Возможные значения:
   - «Все» – при установленном флажке «Все», выбор другого типа ограничения недоступен;
   - «На клиента»;
   - «На группу».
4. «Учет позиций» – доступен, если выбран тип ограничения «На группу». Возможные значения:
   - «Индивид.» – ограничение на группу индивидуально;
   - «Суммарно» – ограничение на группу суммарно.
5. «Код» – код клиенты (группы клиентов). При установленном флажке «Все коды» выбор кода клиента недоступен.
6. «Ограничение на» – вид ограничения. При установленном флажке «на всё» выбор вида ограничения недоступен.
7. «Направление» – направление ограничения. При установленном флажке «Все направления» выбор направления недоступен.

Для экспорта ограничений нажмите на кнопку «Экспорт». Нажатие кнопки «Отмена» закрывает форму.

8. Сообщения

Сообщения отображают результаты действий пользователя (соединение с сервером, изменение групп, ввод и снятие заявок). Сообщения можно просмотреть в Окне сообщений (описание приведено в Руководстве пользователя QUIK, Раздел 2, п.2.9) или в Таблице системных сообщений (описание приведено в Руководстве пользователя QUIK, Раздел 3, п.3.48).

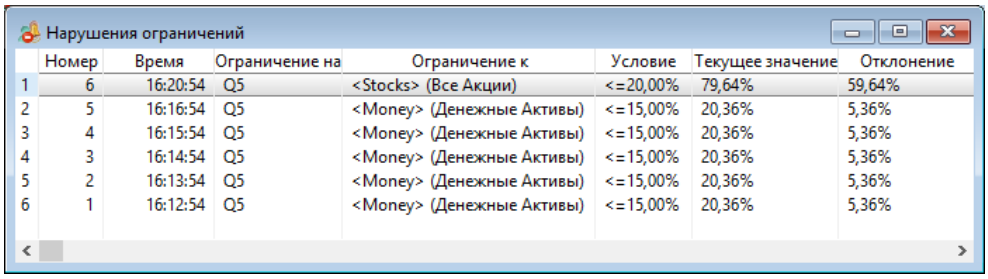
8.1 Предупреждения о нарушении ограничений

меню **Расширения / TrustManager / Нарушения ограничений...**

8.1.1 Назначение

Таблица предназначена для вывода сообщений о нарушении текущим состоянием активов клиентов установленных ограничений. Сообщения выводятся в виде текстовых строк с указанием времени и величины превышения ограничения.

8.1.2 Формат таблицы



	Номер	Время	Ограничение на	Ограничение к	Условие	Текущее значение	Отклонение
1	6	16:20:54	Q5	<Stocks> (Все Акции)	<=20,00%	79,64%	59,64%
2	5	16:16:54	Q5	<Money> (Денежные Активы)	<=15,00%	20,36%	5,36%
3	4	16:15:54	Q5	<Money> (Денежные Активы)	<=15,00%	20,36%	5,36%
4	3	16:14:54	Q5	<Money> (Денежные Активы)	<=15,00%	20,36%	5,36%
5	2	16:13:54	Q5	<Money> (Денежные Активы)	<=15,00%	20,36%	5,36%
6	1	16:12:54	Q5	<Money> (Денежные Активы)	<=15,00%	20,36%	5,36%

Окно представляет собой растущую вниз таблицу, каждая строка которой содержит информацию по отдельному нарушению, зафиксированному в определенный момент времени. Периодичность проверки нарушений задается настройками (меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Ограничения»).

Столбцы таблицы содержат следующие значения:

Заголовок	Назначение
Номер	Порядковый номер нарушения в таблице
Время	Время регистрации нарушения
Ограничение на	Код группы клиента либо группы клиентов, для которого назначено ограничение
Ограничение к	Код группы инструментов, для которого проверяется нарушение
Условие	Условие, заданное в ограничении

Заголовок	Назначение
Текущее значение	Текущее значение стоимости активов, контролируемое ограничением
Отклонение	Величина превышения ограничения
Тип нарушения	Тип нарушения. Возможные значения: _ «проверка» – сообщение о нарушении при периодической проверке ограничений; _ «заявка» – сообщение о нарушении при проверке заявок различных типов, подаваемых через Клиентское место; _ «груп. заявка» – сообщение при проверке групповых заявок различных типов
Тип субъекта ограничения	Тип субъекта, для которого настроено данное ограничение. Возможные значения: _ «клиент»; _ «группа (индивидуально)»; _ «группа (суммарно)»
Описание ограничения	Код ограничения в формате: `(<Субъект>): <Условие>` Где <Субъект> ограничения отображается в виде: _ «кл. <Код клиента>» – для ограничений, заданных на клиентов; _ «гр. <Код группы клиентов> [индивид.]» – для ограничений на группу, заданных на индивидуальные активы клиентов; _ «гр. <Код группы клиентов> [суммарно]» для ограничений на группу, заданных на сумму активов клиентов
Код клиента	Код клиента, для которого произошло нарушение ограничения. Заполняется только при проверке заявок или групповых заявок различных типов
Актив	Актив, по которому подавалась заявка (групповая заявка). Заполняется только при проверке заявок или групповых заявок различных типов.
Доля актива	Доля актива, по которому подавалась заявка, в портфеле клиента. Заполняется только при проверке заявок или групповых заявок различных типов.
Срок расчётов	Срок расчетов
Код ограничения	Уникальный код ограничения
Наименование ограничения	Наименование ограничения

8.1.3 Параметры настройки таблицы

Таблица не содержит настроек.

8.1.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для вывода через DDE-сервер и по ODBC.

В контекстном меню таблицы доступна функция:

- «Удалить сообщения» – очистить все сообщения в таблице.

Описание стандартных функций контекстного меню для таблиц см. в п. 1.3.1.

9. Настройки программы

Диалог настроек модуля TrustManager открывается выбором пункта меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**. Параметры настроек сгруппированы по вкладкам.

9.1 Общие

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Общие»

1. «Группы клиентов»:
   - «Разрешить объединенные группы клиентов» – разрешить операции с объединенными группами клиентов при работе с общей базой данных, информацией о группах пользователей, группах инструментов и ограничениях.
   - «Объединять только денежные позиции» – признак объединения только денежных позиций при расчёте стоимости портфеля объединённых групп клиентов. Настройка доступна, если установлен признак «Разрешить объединённые группы клиентов».
   - «Клиент может входить в несколько групп клиентов» – при включенном признаке один и тот же код клиента может входить в несколько групп клиентов. Если признак отключен, то при создании / редактировании группы клиентов производится проверка на совпадение кодов клиентов в создаваемой / редактируемой группе клиентов с кодами клиентов в существующих группах клиентов. При совпадении кодов клиентов на экран выводится соответствующее предупреждение с предложением удалить совпадающие коды клиентов из данной группы клиентов. При положительном ответе совпадающие коды клиентов удаляются из создаваемой группы клиентов, и группа сохраняется. При отрицательном ответе происходит возврат к редактированию группы клиентов.
2. «Настройки отображения»:
   - «Отображать дополнительные позиции» – включает отображение данных по загруженным инструментам и денежным позициям. Настройка может принимать следующие значения:
     - Включено – отображает позиции по загруженным инструментам и денежным средствам в таблицах «Активы по группе [ ]», «Клиенты по активу [ ] (в группе [ ])» в дополнение к обычным позициям. При этом загруженная позиция отображается одновременно как «Текущий остаток» и «Входящий остаток». Для оценки актива берется значение цены из файла *.dat, загружаемого настройкой «Импорт инструментов» (на вкладке «Импорт данных» окна настроек). Все загруженные инструменты отображаются как члены одного класса «Загруженные инструменты»;

- Выключено – не отображает загруженные инструменты и денежные позиции, но использует их для расчета ограничений. Значение по умолчанию.

- «Учет сделок РЕПО» – учитывать в стоимости средств клиента обязательства по сделкам РЕПО.

9.2 Торговля

9.2.1 Заявки

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Торговля» / «Заявки»

1. «Настройки по умолчанию»:

   - «Торговый счёт» – выбор из списка торгового счета, который будет использован по умолчанию, если при подаче групповой заявки среди инструментов конкретного клиента группы не найден торговый счет по текущему инструменту.
   - «Группа клиентов» – выбор из списка кода группы, который будет указываться во всех групповых заявках по умолчанию.
   - «Разбиение групповой заявки» – выбор способа округления объемов индивидуальных заявок при разбиении:
     - «Округление долей вниз (к нулю)» – округлять объемы заявок вниз до ближайшего целого значения.
     - «Округление долей с сохранением суммарного количества» – округлять объемы заявок либо вниз, либо вверх таким образом, чтобы суммарный их объем был равен объему групповой заявки.
   - «Объём заявки как изменение доли актива в портфеле» – в форме ввода групповой заявки переключатель «Объем заявки» устанавливается по умолчанию в положение «Повысить (Понизить) до … %».
   - «Купить на всё при подаче новой заявки» – в форме ввода групповой заявки на покупку признак «Купить на все сред-ва» устанавливается по умолчанию. Флажок доступен при включенном флажке «Объём заявки как изменение доли актива в портфеле».

2. «Разрешить ручную коррекцию групповых заявок» – после ввода параметров групповой заявки показывать окно редактирования объемов индивидуальных заявок в сформированном пакете.
3. «Разрешить фильтр по группам инструментов» – отображать поле выбора группы инструментов в окне ввода групповой заявки.
4. «Ожидать снятия заявок при замене групповой заявки» – свойство операции замены групповых заявок: сначала выполнить снятие всех заявок, затем ввести новые с измененными параметрами.
5. «Отображать нарушения ограничений при подаче заявок» – отображать список нарушений в окне «Нарушения ограничений». По умолчанию флажок снят.
6. «Подробная диагностика формирования заявок» – включает возможность в процессе формирования групповой заявки получать диагностику по каждому коду клиента, не вошедшему в групповую заявку. Диагностика отображается в Таблице сообщений. По умолчанию флажок снят.

Параметры заявок

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Торговля» / «Заявки» / «Параметры заявок»

1. «Использовать комментарии при подаче заявок» – включает возможность указания комментария к заявкам по коду клиента, отправленным в составе определенной группы клиентов.
2. «Групповые заявки подавать только полностью» – свойство ввода новой групповой заявки любого типа: если какая-либо заявка в составе групповой была отвергнута сервером QUIK либо торговой системой биржи, то прекращается ввод заявок из данной групповой заявки и снимаются все ранее введенные индивидуальные заявки, за исключением уже исполненных.
3. «Порядок подачи в групповой заявке» – настройка порядка подачи заявок в составе групповой заявки. Возможные значения:

   - «Согласно порядку клиентов в группе» – заявки подаются в том же порядке, в каком расположены клиенты внутри группы клиентов. Значение по умолчанию.
   - «Обратно проценту прироста стоимости портфеля» – заявки подаются в соответствии с возрастанием соотношения:

     Стоимость портфеля клиента (текущие позиции по «текущей цене») / Стоимость портфеля на начало дня (входящие позиции по «предыдущей цене») – 1.
   - «Случайным образом» – заявки подаются в случайном порядке.
4. «Направление заявки из таблиц с активами» – направление операции, выбранное по умолчанию в окне ввода групповой заявки, открытом из таблицы «Текущие торги» или из следующих таблиц модуля TrustManager: «Активы по группе», «Клиенты по активу», «Позиции на срочном рынке по группе клиентов», «Лимиты на срочном рынке по группе клиентов», «Торговые счета по инструменту», «Торговые счета по ограничению», «Информация по активам группы».

   - «Продажа для инструмента / Покупка для денег» – в окне ввода заявки для всех типов активов, кроме денежного, выбирается направление «Продажа », а для денежного актива – «Покупка».
   - «Покупка для инструмента / Продажа для денег» – в окне ввода заявки для всех типов активов, кроме денежного, выбирается направление « Покупка», а для денежного актива – «Продажа».
   - «Не указывать операцию» – направление не выбрано.

   На выбор направления по умолчанию в окне ввода групповой заявки, открытом из Таблицы котировок, влияет настройка Рабочего места QUIK «Установка операции заявки» (меню **Система / Настройки / Основные настройки**, раздел **Торговля / Заявки**).

9.2.2 Айсберг-заявки

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Торговля» / «Айсберг-заявки»

1. «Разрешить замену айсберг-заявок на обычные» – если индивидуальная заявка с типом «Айсберг», образованная групповой заявкой, не удовлетворяет условиям торговой

системы для айсберг-заявок, то она автоматически заменяется на обычную заявку. По умолчанию флажок снят. Если флажок установлен, доступны следующие настройки:

- «Список классов для замены айсберг-заявок (через ‘,’)» – список классов, по которым производится замена айсберг-заявок на обычные, если включена настройка «Разрешить замену айсберг-заявок на обычные» и индивидуальная заявка с типом «Айсберг», образованная групповой заявкой, не удовлетворяет условиям торговой системы для айсберг-заявок. Если список не задан (по умолчанию), то замена айсберг-заявок производится для всех классов Московской биржи.
- «Загружать параметры инструментов» – признак загрузки параметров айсберг-заявок по инструментам из файла. Чтобы выбрать файл, нажмите кнопку «…». Описание формата файла приведено в п. 10.10.

  Если файл не выбран, то минимальное видимое количество для классов Московской биржи равно 100 лотам, а для других классов не задано. Если файл выбран, но пуст, то минимальное видимое количество не задано для всех инструментов.

9.2.3 Оценка позиций

меню **Расширения / TrustManager / Настройки…**, вкладка «Торговля» / «Оценка позиций»

Настройка оценки позиций предназначена для выбора цены для оценки стоимости актива в портфеле клиента (или группы клиентов).

2. «Тип цены для оценки позиции (тек. цена)» – выбор типа цены для оценки позиций. Возможные значения:
   - «Цена послед.» – цена последней сделки по данным торговой системы; значение выбрано по умолчанию;
   - «Предл.» – лучшая цена предложения;
   - «Призн.кот.пред.» – признаваемая котировка предыдущей торговой сессии;
   - «Спрос» – лучшая цена спроса;
   - «Ср.вз.цена» – средневзвешенная цена.
3. «Доступные классы» – выберите класс из этого списка, для которого необходимо определить тип цены оценки позиций и нажмите кнопку «Добавить», либо нажмите дважды левую кнопку мыши. Класс появится в списке справа. Список доступных классов состоит из классов инструментов фондового рынка.
4. «Редактирование типа цены» – список классов для выбора цены оценки позиций.
   - «Класс» – наименование класса инструментов;
   - «Тип цены» – назначаемый тип цены для оценки. Возможные значения:
     - «Цена послед.» – цена последней сделки по данным торговой системы, значение выбрано по умолчанию;
     - «Призн.кот.пред.» – признаваемая котировка предыдущей торговой сессии;
     - «Спрос» – лучшая цена спроса;
     - «Предлож.» – лучшая цена предложения;
     - «Загруж.» – цена инструмента, загруженная из файла в результате импорта, подробнее см. «Импорт описаний инструментов и их цен»;

- «Ср.вз.цена» – средневзвешенная цена.

При выборе типа цены «Признаваемая котировка» оценка будет производиться исходя из значения параметра «Признаваемая котировка вчерашнего дня», так как значение признаваемой котировки обновляется только после окончания торгового дня. Если значение параметра «Признаваемая котировка» будет равна нулю, то актив будет оценен по нулевой цене. Для инструмента с выбранным типом цены «Спрос», «Предложение» или «Последняя сделка» соответствующие параметры, в «Таблице текущих торгов» могут оказаться нулевыми, в этом случае оценка стоимости инструмента производится по цене закрытия предыдущего дня.

5. «Тип цены при отсутствии тек. цены (пред. цена)» – выбор типа цены, если текущая цена отсутствует. Возможные значения:
   - «Призн. кот. пред.» – признаваемая котировка предыдущей торговой сессии,
   - «Цена закр.» – цена закрытия.
6. «Расчет ликвидационной стоимости опционов» – способ расчета ликвидационной стоимости опционов при расчете стоимости портфеля. Возможные значения:
   - «По спросу и предложению»;
   - «С учетом теоретической цены».
7. «Использование цены из внешнего файла» – дополнительные параметры, указывающие на использование загружаемой из файла цены в случае отсутствия других параметров:
   - «Использовать только текущую цену и предыдущую цену» – цена оценки выбирается по алгоритму, описанному в предыдущем пункте.
   - «При отсутствии текущей цены сначала брать цену из внешнего файла, а при её отсутствии брать предыдущую цену» – позволяет использовать импортированную цену для оценки позиции, если в настоящий момент не транслируется цена инструмента с сервера QUIK. Если настройка включена, то для того, по какой цене следует оценивать позиции по инструменту, сначала берётся указанная текущая цена (последней сделки, спроса, предложения или признаваемой котировки). Если текущая цена не найдена, используется цена из загруженного файла с описаниями инструментов (если такой файл имеется в наличии). В случае отсутствия цены в загруженном файле используется цена закрытия предыдущего дня.
   - «При отсутствии предыдущей цены брать цену из внешнего файла» – означает, что если на момент оценки нет цены закрытия, то его оценка производится по импортированной цене. Если настройка включена, то для определения того, по какой цене следует оценивать позицию по инструменту, сначала берется указанная текущая цена (последней сделки, спроса, предложения). Если текущая цена отсутствует, то используется цена закрытия. Если цена закрытия не найдена, то берется цена из импортируемого файла.
   - «Для загруженных инструментов всегда использовать цену из внешнего файла» – при установленном флажке для инструментов, загруженных из внешнего файла, используется только цена, загруженная из внешнего файла. По умолчанию флажок установлен.

> **ВАЖНО! При отсутствии загруженного описания позиций инструмент не отображается в портфеле TrustManager по группе либо по клиенту.**

> **Если в графе «Импорт инструментов» на вкладке «Импорт данных» включена настройка «Загружать файл с интервалом», то введенная вручную цена будет потеряна при очередной загрузке данных из файла.**

9.3 Ограничения

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Ограничения»

1. «Для ограничений снизу на долю в портфеле брать только стоимость инструментов в качестве оценки портфеля» – определять долю актива в стоимости всех инструментов без учета денежного остатка. Если флажок установлен, то доля определяется в стоимости инструментов, денежный остаток при этом не учитывается. Если флажок снят, доля определяется в стоимости портфеля с учётом денежного остатка.
2. «Запрет на отключение ограничений» – если флажок установлен, то в диалогах подачи групповых заявок (всех типов) невозможно отключить настройку «Использовать ограничения».
3. «Не учитывать НКД при расчете ограничений» – не учитывать НКД при расчёте оценки стоимости облигаций.
4. «Периодическая проверка ограничений» – включить проверку соблюдения ограничений текущей стоимостью активов групп и клиентов.
   - «Периодически проверять выполнение ограничений» – режим автоматической проверки выполнения ограничений. По умолчанию проверка включена.
   - «Период проверки ограничений (мин.)» – интервал проверки соблюдения ограничений, в минутах. По умолчанию: «1».
5. «Загрузка описаний ограничений» – выбор файла с расширением *.dat, содержащего описание ограничений.
   - «Загружать при запуске описания ограничений из файла» – включить загрузку ограничений при запуске программы.
   - Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить загрузку указанного файла вручную.
6. «Загрузка эталонных портфелей» – параметры загрузки эталонных портфелей, используемых для контроля величины отклонения стоимости текущего портфеля от заданного эталона.
   - «Загружать описания эталонных портфелей» – разрешает работу с эталонными портфелями.
   - В расположенном ниже поле укажите путь к текстовому файлу с описанием цен по инструментам либо выберите его на диске, нажав кнопку «...».
   - «Загружать файлы с интервалом (мин.)» – включает периодическую загрузку файла через определенный интервал времени. Значение интервала вводится в минутах.
   - Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить загрузку указанного файла вручную.

> **Если файл с эталонным портфелем не указан, в качестве эталонных значений используются входящие позиции клиента.**

9.4 Хранение данных

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Хранение данных»

1. «ODBC источник» – имя (алиас) ODBC-источника, указывающего на базу данных, используемую модулем TrustManager.
2. «Логин» – имя пользователя базы данных;
3. «Задать пароль» – при нажатии на кнопку открывается окно ввода пароля пользователя, в котором доступны следующие поля:
   - «Новый пароль» – значение пароля;
   - «Подтверждение пароля» – повтор значения, введенного в поле «Новый пароль»;
   - «Шифровать пароль» – при установленном флажке пароль сохраняется в зашифрованном виде.

> **Пароль не может начинаться с символов «$» и «#». При переносе программы на другой компьютер или переустановке операционной системы, зашифрованные пароли становятся недоступными для дешифрования. В таком случае необходимо указать соответствующие пароли заново.**

> 1. **Параметры Логин и Пароль используются при работе с базами данных, требующими ввода имени и пароля пользователя. При изменении используемой базы данных не требующей ввода имени/пароля (например, MS Access), на другую, в которой их ввод обязателен (например, MS SQL), помимо выбора нового ODBC-источника требуется указать эти параметры, иначе программа не сможет подключиться к базе данных.**
> 2. **Если при подключении к базе данных используется доменная аутентификация, то параметры Логин и Пароль не указываются.**

4. «Поддержка многопользовательской работы» – режим работы нескольких пользователей TrustManager с общей базой данных с информацией о группах пользователей, группах инструментов и ограничениях.

9.5 Импорт данных

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Импорт данных»

1. «Использовать описания инструментов и позиций в базе данных» – настройка хранения данных по дополнительным загруженным описаниям инструментов (см. п.10.2) и позициям клиентов (см.пп.10.3-10.4) в базе данных программы. Настройка полноценно

работает только для базы MS SQL. При работе плагина с базами данных других типов, в момент запуска плагина осуществляется только загрузка описаний дополнительных инструментов и дополнительных позиций без учета их изменений в процессе работы плагина. По умолчанию настройка выключена.

> **Для корректного функционирования плагина при использовании данной настройки не рекомендуется включать импорт описаний дополнительных инструментов и дополнительных позиций из файла более, чем на одном экземпляре плагина TrustManager.**

2. «Импорт групп инструментов» – выбор файла с описанием групп инструментов.

   - «Загружать при запуске описания групп инструментов» – включает загрузку указанного файла с описанием групп инструментов при каждом запуске программы.

3. «Импорт инструментов» – настройки для импорта описаний активов и их цен, информация по которым отсутствует в системе QUIK. Для каждого клиента или группы клиентов может быть задано свое значение цены инструмента. Это позволяет использовать разные цены для оценки позиций по одному активу у разных клиентов. Определение цены актива для клиента, если необходимо воспользоваться загруженной ценой из файла, осуществляется в следующей последовательности:
   1. Цена актива для кода клиента (высший приоритет);
   2. Цена актива для группы клиентов (для членов группы, которым цена не задана на код клиента).

   > **Включение клиента в несколько групп, для которых заданы разные цены, приведет к ошибочному определению цены для такого клиента.**

   3. Цена актива общая для всех (используется, если цена не задана индивидуально ни на группу, в которую клиент входит, ни на код клиента).

   Параметры настройки:

   - «Загружать описания инструментов» – разрешает загрузку описаний из файла согласно указанным ниже настройкам.
   - В расположенном ниже поле укажите путь к файлу с описанием цен по инструментам либо выберите его на диске, нажав кнопку «…». Рекомендуемое расширение имени файла – *.dat.
   - «Загружать файл с интервалом (мин.)» – включает периодическое чтение файла с описанием инструментов. В поле справа указывается интервал чтения файла, в минутах.
   - Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить чтение данных из указанного выше файла вручную.
   - Кнопка «Ред-ть инструменты» – открывает таблицу «Загруженные инструменты», в которой параметры инструментов доступны для редактирования (см. п. «Редактирование инструментов»).

Если инструмент отсутствует на сервере QUIK, то всегда используется цена из внешнего файла по данному инструменту. При отсутствии загруженного описания позиций инструмент не отображается в портфеле TrustManager по группе либо по клиенту.

4. «Импорт позиций» – настройки для загрузки стоимости активов.

- «Загружать описания позиций» – разрешает загрузку дополнительных позиций согласно указанным ниже настройкам.
- В расположенном ниже поле укажите путь к файлу с описанием дополнительных позиций либо выберите его на диске, нажав кнопку «…». Рекомендуемое расширение имени файла – *.dat.
- «Загружать файл с интервалом (мин.)» – включает периодическое чтение файла с описанием дополнительных позиций. В поле справа указывается интервал чтения файла, в минутах.
- Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить чтение данных из указанного выше файла вручную.

Если в ограничениях используются группы инструментов, загруженные из файла, то при отключении импорта, данные из групп инструментов исчезнут. На экране появится сообщение вида: «Вы уверены, что хотите отключить импорт описаний инструментов (позиций). Это приведет к удалению информации по всем инструментам (позициям), загруженным из внешнего источника».

ВАЖНО! При централизованном обновлении данных по загруженным инструментам и позициям, рекомендуется:

1. **На одном экземпляре программы включить импорт соответствующих данных из файла и одновременно включить их хранение в базе данных программы. При этом программа получает данные по инструментам и их ценам из файла и сохраняет их в базе данных.**
2. **На остальных экземплярах программы включить хранение этих же данных в базе данных программы. При этом программа получает данные из базы данных.**

9.5.1 Транзакции

меню **Расширения / TrustManager / Настройки…**, вкладка «Импорт данных» / «Транзакции»

1. «Файл с исходными данными о транзакциях» – выбор файла для импорта транзакций (.tri).

- «Обрабатывать через (сек.)» – периодичность чтения файла на наличие в нем новых транзакций, в секундах.
- «Оповещать об обработке файла звуковым сигналом» – включает звуковой сигнал при обращении к файлу.

2. «Файл с данными об успешно отправленных транзакциях» – выбор файла для сохранения отправленных транзакций (.tro).
3. «Файл с журналом отправляемых транзакций» – выбор файла для записи журнала обработки транзакций (.trr).

    - «Вести журнал отправляемых транзакций» – включает запись сообщений в указанный файл.

4. Поля со справочной информацией о результатах обработки транзакций:

    - «Число обращений, сделанных к файлу» – количество обращений к файлу;
    - «Число прочитанных из файла строк» – суммарное количество обработанных уникальных строк;
    - «Число отправленных групповых транзакций» – количество групповых транзакций, отправленных на сервер за текущую итерацию (обращение к файлу);
    - «Число отправленных транзакций» – количество индивидуальных транзакций, переданных на сервер в результате реализации групповой заявки, за текущую итерацию;
    - «Всего отправлено транзакций» – суммарное количество отправленных транзакций с момента начала импорта из файла;
    - «Всего выполнено транзакций» – суммарное количество успешно зарегистрированных транзакций с момента начала импорта из файла.

5. Кнопка «Начать обработку» – начать импорт транзакций из файла.
6. Кнопка «Прекратить обработку» – остановить импорт транзакций из файла.
7. «Начинать динамическую загрузку транзакций автоматически» – начинать импорт транзакций из указанного файла с заданной периодичностью при запуске программы.

9.5.2 Пулы заявок

меню **Расширения / TrustManager / Настройки…**, вкладка «Импорт данных» / «Пулы заявок»

1. «Использовать пулы заявок» – включенный флажок позволяет импортировать пулы заявок и разрешает работу с ними.
2. «Директория импорта пулов» – путь к каталогу с загружаемыми файлами.

    - «Загружать файлы с периодом (мин.)» – если флажок включен, программа будет периодически проверять импортировать данные из файлов в указанном каталоге. Если флажок отключен, импорт выполняться не будет. Периодичность импорта указывается в минутах.

3. «Файл для записи результатов импорта» – путь к файлу с результатами импорта пулов заявок. Файл не должен располагаться в каталоге с импортируемыми пулами.
4. «Проверять пулы на повтор данных» – если флажок установлен, то импортируемые пулы заявок проверяются на наличие повторяющихся данных для предотвращения импорта одинаковых пулов. Если флажок снят, то все пулы загружаются безусловно.
5. «Разрешить разбиение заявок на части» – если флажок установлен, то разрешается дробить заявки в соответствии настройками, установленными для клиентских групп (окно «Создание группы клиентов», признак «Дополнительно разбивать заявки на … частей»).
6. Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить импорт пулов заявок вручную.

9.5.3 Рейтинговые агентства

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Импорт данных» / «Рейтинговые агентства»

1. «Загрузка описаний агентств» – выбор текстового файла, содержащего описание агентств и используемых ими рейтингов. Описание формата файла приведено в п.10.9.1.
   - «Читать описания агентств из БД» – если флажок включен, то все остальные настройки импорта данных по агентствам запрещены.
   - «Загружать при запуске описания агентств из файла» – включить загрузку текстового файла с описанием агентств при запуске программы.
   - Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить загрузку указанного файла вручную.
2. «Загрузка значений рейтингов для инструментов и эмитентов» – выбор текстового файла, содержащего описание рейтингов по отдельным инструментам или эмитентам. Описание формата файла приведено в п. 10.9.2.
   - «Загружать при запуске описания рейтингов из файла» – включить загрузку текстового файла с описанием рейтингов при запуске программы.
   - Кнопка «Загрузить сейчас» – выполнить загрузку указанного файла вручную.

> **Если в ограничениях используются группы инструментов, основанные на рейтингах (загруженные из файла), то при отключении импорта, данные из групп инструментов будут удалены. На экране появится сообщение вида: «Имеются группы инструментов, в которых используется информация о рейтингах, изменение данных по рейтинговым агентствам может повлиять на эти группы. Вы уверены?»**

9.6 Дополнительно

меню **Расширения / TrustManager / Настройки...**, вкладка «Дополнительно»

«Вести логирование» – логирование работы плагина. По умолчанию логирование включено.

10.Форматы файлов для импорта данных

10.1 Импорт групп инструментов

Данным действием выполняется загрузка описаний групп инструментов из текстового файла, либо их модификация. Рекомендуемое расширение файла – *.dat.

Каждая строка содержит одну команду на добавление, изменение или удаление группы инструментов, или одну команду на добавление или удаление параметра в группе инструментов. Строки исполняются в том порядке, как они содержатся в файле.

Чтобы **сформировать** группу инструментов, необходимо подать команду на создание группы, а следующими командами (строками) добавить в нее инструменты.

Чтобы **изменить** группу, необходимо подать команду на модификацию группы инструментов (в ней можно также изменить название этой группы), а следующими командами (строками) добавить или удалить параметры в группе инструментов.

Чтобы **удалить** группу инструментов, необходимо подать команду на удаление группы инструментов.

Изменение группы заканчивается, если в очередной строке содержится команда на создание, изменение или удаление другой группы, либо по достижении конца файла.

Параметр	Назначение
Команды	
ADD SEC_GROUP:	Добавление группы инструментов. Содержит параметры: «CODE», «DESC», «LISTLEVEL»*
DEL SEC_GROUP:	Удаление группы инструментов. Содержит параметр «CODE»
MODIFY SEC_GROUP:	Изменение группы инструментов. Содержит параметры: «CODE», «DESC», «LISTLEVEL»*
ADD SEC_ITEM:	Добавление инструмента в группу. Содержит параметры: «TYPE», «CODE», «CLASS»
DEL SEC_ITEM:	Удаление инструмента из группы. Содержит параметры: «TYPE», «CODE», «CLASS»
Параметры команд	
TYPE	Тип инструмента, может принимать значения: _ «SECURITY» – отдельный инструмент; _ «SEC_CLASS» – класс инструментов; _ «SEC_GROUP» – другая группа инструментов; _ «INV_SEC_GROUP» – все инструменты, не входящие в указанную группу инструментов.
CLASS	Код класса. Параметр доступен только для «TYPE=SECURITY». Если этот инструмент принадлежит к классу, описание которого загружено из внешнего файла, то в качестве кода класса указывается значение «$LOADED»
CODE	Код инструмента. Параметр может принимать значения: _ при значении «TYPE=SECURITY» – код инструмента; _ при значении «TYPE=SEC_CLASS» – код класса инструментов; _ при значениях «TYPE=SEC_GROUP» – код группы инструментов; _ при значениях «TYPE=INV_SEC_GROUP» – код группы инструментов
DESC	Название группы инструментов в виде строк и длиной не более 50 символов

Параметр	Назначение
OPERATION	Тип операции над элементами. Параметр может принимать значения: _ «OR» – для обычных групп, когда элементы группы объединяются (по умолчанию); _ «AND» – для групп типа «пересечение», когда элементы группы пересекаются

* – необязательный параметр. Возможные значения:

- «-1» – уровень листинга не установлен;
- «0» / «1» / «2» / «3» – уровень листинга для группы инструментов

10.1.1 Примеры строк

```
ADD SEC_GROUP: CODE=GroupA; DESC=Стабильные; LISTLEVEL=1;
ADD SEC_ITEM: TYPE=SECURITY; CLASS=TQBR; CODE=LKOH;
ADD SEC_ITEM: TYPE=SEC_CLASS; CODE=TQOB;
```

Команды исполняются в порядке следования строк:

__ Создается новая группа с кодом GroupA, названием «Стабильные» и уровнем листинга «1»;

__ В группу GroupA добавляется отдельный инструмент;

__ В группу GroupA добавляется класс инструментов.

```
ADD SEC_GROUP: CODE=GroupB; DESC=Постоянные; LISTLEVEL=-1;
ADD SEC_ITEM: TYPE=SEC_GROUP; CODE=GroupA;
ADD SEC_ITEM: TYPE=SECURITY; CLASS=$LOADED; CODE=SOMECODE1;
```

Команды исполняются в порядке следования строк:

__ Создается новая группа с кодом GroupB и названием «Постоянные», уровень листинга группы инструментов не установлен;

__ В группу GroupB добавляется другая группа инструментов с кодом GroupA;

__ В группу GroupB добавляется инструмент с кодом SOMECODE1, который загружен из внешнего файла.

```
MODIFY SEC_GROUP: CODE=GroupA;
ADD SEC_ITEM: TYPE=SECURITY; CLASS=TQBR; CODE=RTKM;
DEL SEC_ITEM: TYPE=SECURITY; CLASS=TQBR; CODE=LKOH;
```

Команды исполняются в порядке следования строк:

- Начинается редактирование существующей группы инструментов с кодом GroupA, с учётом нижеследующих команд;
- В группу GroupA добавляется отдельный инструмент;
- Из группы GroupA удаляется отдельный инструмент.

```
DEL SEC_GROUP: CODE= GroupB;
```

- Существующая группа GroupB удаляется.

10.2 Импорт описаний инструментов и цен

Данным действием выполняется загрузка описаний дополнительных инструментов, отсутствующих на сервере QUIK, а также цен таких инструментов.

Файл с расширением *.dat состоит из нескольких секций, в каждой из которых определяется один из активов. Секция описания инструмента состоит из начальной строки с командой «SECURITY:», после которой следует перечисление параметров вида <параметр>=<значение>, разделенных запятыми. После начальной строки могут следовать строки с командой «FOR CLIENT:», в которых определяются индивидуальные цены для кодов клиентов и групп клиентов. Секция заканчивается, если в очередной строке содержится команда «SECURITY:» (задающая цену на следующий актив), либо по достижении конца файла.

Заголовок	Назначение
Команды	
SECURITY:	Определение актива и его стоимости. Содержит параметры: «NAME», «PRICE», «STYLE», «SECTYPE», «FACE_VALUE», «ACC_INT»
FOR CLIENT:	Ввод значения стоимости актива, указанного в вышестоящей строке с командой «SECURITY:», которое будет применяться для отдельного клиента или группы клиентов. Содержит параметры: «CODE» либо «GROUP_CODE», «PRICE»
Параметры команд	
NAME	Наименование инструмента (не более 16 символов)
PRICE	Цена инструмента. Может быть указана в валюте (для акций) или в процентах (для облигаций) с точностью до шести знаков после запятой
STYLE	Тип инструмента. Для облигаций имеет значение «BOND», для остальных типов инструментов параметр не указывается
SECTYPE	Расширенный тип инструмента, указывающий на включение инструмента в состав предопределенной группы инструментов. Например, SECTYPE=BondsCorp означает, что загруженный инструмент будет включен в состав предопределенной группы «Корпоративные облигации»

Заголовок	Назначение
FACE_VALUE	Номинал облигации
ACC_INT	Накопленный купонный доход по облигации
CODE	Параметр может принимать значения: _ в строке с командой «SECURITY:» обозначает код инструмента (не более 12 символов), _ в строке с командой «FOR CLIENT:» обозначает код клиента
GROUP_CODE	Код группы клиентов (не более 64 символов)

10.2.1 Примеры строк

```
SECURITY: CODE = LSE_LKOH; NAME = LSE Лукойл; PRICE = 5245,56;
FOR CLIENT: CODE=E2; PRICE=5200,00;
FOR CLIENT: GROUP_CODE=Some2; PRICE=5250,00;
```

Команды исполняются в порядке следования строк:

- Для инструмента LSE LKOH с именем LSE Лукойл вводится значение цены 5245,56 для всех клиентов, кроме тех, которым в нижеследующих строках определяется индивидуальное значение цены на этот актив;
- Для клиента с кодом E2 значение цены на актив LSE LKOH вводится равным 5200,00;
- Для группы клиентов Some2 значение цены на актив LSE LKOH вводится равным 5250,00.

```
SECURITY: NAME = RU000A0JP8V0; PRICE = 310; STYLE = BOND; FACE_VALUE=1000;
ACC_INT=27,1400;
```

Инструмент RU000A0JP8V0 является облигацией с номиналом 1000 рублей, НКД 27,14 и ценой 310.

10.3 Импорт дополнительных позиций по инструментам

Данным действием выполняется загрузка позиций клиентов, которые отсутствуют на сервере QUIK. Файл имеет расширение *.lim и может содержать строки с позициями по инструментам, подобно файлу загрузки лимитов в QUIK.

Структура файла:

Параметр	Назначение
DEPO:	Заголовок строки с отражаемой позицией по инструментам
FIRM_ID	Идентификатор участника торгов
SECCODE	Код инструмента
CLIENT_CODE	Код клиента
OPEN_BALANCE	Позиция клиента
LIMIT_KIND	Срок расчетов

10.3.1 Пример файла

```
DEPO: FIRM_ID = NC0038900000; SECCODE = LKOH; CLIENT_CODE = E2; OPEN_BALANCE = 1000;
LIMIT_KIND = 0;
```

10.4 Импорт дополнительных денежных позиций

Данным действием выполняется загрузка денежных позиций клиентов, которые отсутствуют на сервере QUIK. Файл имеет расширение *.lim и может содержать строки с денежными позициями, подобно файлу загрузки лимитов в QUIK.

Структура файла:

Параметр	Назначение
MONEY:	Заголовок строки с отражаемой денежной позицией
FIRM_ID	Идентификатор участника торгов
CURR_CODE	Код валюты
CLIENT_CODE	Код клиента
OPEN_BALANCE	Позиция клиента
LIMIT_KIND	Срок расчетов

10.4.1 Пример файла

```
MONEY: FIRM_ID = NC0038900000; CURR_CODE = USD; CLIENT_CODE = Q2; OPEN_BALANCE =
5000; LIMIT_KIND = 1;
```

10.5 Импорт ограничений

Строки исполняются строго в порядке их расположения в файле. Если строка относится к добавлению ограничения, то она начинается с символов «ADD RULE:».

Каждая строка файла является ограничением. Файл поддерживает следующие параметры:

Параметр	Назначение
ADD RULE:	Заголовок строки, содержащей добавление ограничения
CLIENT_CODE или GROUP_CLIENT_CODE	Код клиента или группы клиентов, для которых устанавливается ограничение. Совместно не используются.
RULE_TYPE	Параметр может принимать значения: _ «NO_TRADE» – запрет на торговлю; _ «SEC_GROUP» – ограничение на долю группы инструментов; _ «ANY_SEC» – ограничение на любой инструмент; _ «DELTA_PORTFOLIO» – ограничение на изменение портфеля; _ «ANY_EMITENT» – ограничение на инструменты любого эмитента
SIGN	Направление ограничения. Не используется при значении параметра «RULE_TYPE=NO_TRADE». Параметр может принимать значения: _ «NOT_LOWER» – не ниже указанного значения; _ «NOT_MORE» – не выше указанного значения
SEC_GROUP	Код группы инструментов, для которого устанавливается ограничение. Для предопределённых групп инструментов указываются коды этих групп. Для «RULE_TYPE=ANY_SEC»: если указано, то ограничение устанавливается на долю любого инструмента из указанной группы инструментов, если не указано, то доля инструмента измеряется к оценке портфеля
LIMIT	Численный лимит ограничения. Указывается в процентах, в качестве десятичного разделителя используется запятая. Не используется при значении параметра «RULE_TYPE=NO TRADE»
FULL	Тип показателя, по отношению к которому определяется доля стоимости группы инструментов. Используется только для «RULE_TYPE=SEC_GROUP». Параметр может принимать значения: _ «PORTFOLIO» – к оценке портфеля; _ «SEC_GROUP» – к оценке стоимости другой группы инструментов; _ «FREE_FLOAT» – к объему обращения. Используется только для значения параметра «RULE_TYPE=SEC_GROUP»; _ «VALUE» – абсолютное ограничение на стоимость группы инструментов; _ «FREE_FLOAT_BY_GROUP» – объём обращения суммируется по инструментам либо по выпускам одного инструмента; _ «COUNT» – ограничение на количество инструментов в группе

Параметр	Назначение
CO_SEC_GROUP	Код группы инструментов, по отношению к которому считается доля стоимости группы инструментов из параметра «SEC_ GROUP». Используется только для «FULL=SEC_GROUP»
VALUE	Величина ограничения оценки позиций в абсолютном выражении. Используется только для «FULL=VALUE»
SUMMARY	Суммарно по группе клиентов. Если указано значение «Y»/«YES», то ограничение применяется к суммарным активам группы клиентов. Используется для «GROUP_CLIENT_CODE»
IGNORE_ACCINT	Не учитывать НКД. Если указано значение«Y»/«YES», то в ограничении не учитывается НКД при расчёте стоимости облигации
LIMIT_KIND	Целое неотрицательное число, задающее срок расчетов. При этом, если ограничение применяется к позициям по всем видам лимитов, то параметр равен «-1». Если параметр не указан, то считается, что ограничение применяется к сроку расчета «T0»
RESTR_CODE	Строка (не более 12 символов), задающая уникальный код ограничения. Необязательный параметр
RESTR_NAME	Строка (не более 50 символов), задающая наименование ограничения. Необязательный параметр

Если строка относится к удалению ограничения, то она начинается с символов «DEL RULE:» и поддерживает следующие параметры:

Параметр	Назначение
DEL RULE:	Параметр начала строки, содержащей удаление ограничения
REMOVE_TYPE	Тип удаления ограничений. Параметр может принимать значения: _ «ALL» – удаляются все имеющиеся ограничения. Все прочие параметры игнорируются; _ «CLIENT_CODE» – удаляются все ограничения по указанному клиенту или группе клиентов; _ «DETAILED» – удаляет ограничение, которое имеет точно такие же параметры; _ «RESTR_CODE» – удаляет ограничение по его коду
CLIENT_CODE или GROUP_CLIENT_CODE	Код клиента или группы клиентов для которых удаляются ограничения. Используется совместно со значениями «CLIENT_CODE» или «DETAILED» параметра «REMOVE_TYPE»

Значение параметра REMOVE_TYPE=DETAILED позволяет выборочно удалять ограничения. Для этого необходимо подробно указать параметры конкретного ограничения. Если в процессе обработки файла возникли ошибки, то в «Окне сообщений» появится уведомление.

Ниже приведены примеры импорта различных типов ограничений.

10.5.1 Примеры ограничений на клиента

1. Ограничение на клиента на группу инструментов «Денежные активы» не более 100 000 рублей без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>;
VALUE=100000; IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE; LIMIT_KIND = 1;
```

2. Ограничение на клиента на группу инструментов «Денежные активы» не более 100 000 рублей с учетом НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; VALUE =
100000; SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE; LIMIT_KIND = 1;
```

3. Ограничение на клиента на группу инструментов «Денежные активы» не более 10 процентов от стоимости клиентского портфеля без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; LIMIT = 10;
IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = PORTFOLIO; LIMIT_KIND = 2;
```

4. Ограничение на клиента на группу инструментов «Денежные активы» не более 10 процентов от стоимости группы инструментов без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; LIMIT = 10;
IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = SEC_GROUP; CO_SEC_GROUP = <Money>;
LIMIT_KIND = 0;
```

5. Ограничение на клиента на группу инструментов «Денежные активы» не более 10 процентов от объема обращения:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; LIMIT = 10;
IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = FREE_FLOAT;
```

6. Ограничение на клиента на любой инструмент из всего портфеля не более 130 000 рублей без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = ANY_SEC; VALUE=130000; IGNORE_ACCINT = YES;
SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE; LIMIT_KIND = 2;
```

7. Ограничение на клиента на любой инструмент из группы инструментов «Денежные активы» не более 170 000 рублей без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = ANY_SEC; SEC_GROUP = <Money>; VALUE =
170000; IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE; LIMIT_KIND = 1;
```

8. Ограничение на клиента на любой инструмент из группы инструментов «Денежные активы» не более 18 процентов от стоимости клиентского портфеля без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = ANY_SEC; SEC_GROUP = <Money>; LIMIT = 18;
IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = PORTFOLIO;
```

9. Ограничение на клиента на инструмент любого эмитента из группы инструментов не более 23 процентов от стоимости клиентского портфеля:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = ANY_EMITENT; SIGN = NOT_MORE; SEC_GROUP =
<StocksCom>; LIMIT = 23; FULL = PORTFOLIO;
```

10. Ограничение на клиента на любой инструмент из группы инструментов «Денежные активы» не более 82 процентов от стоимости группы инструментов без учета НКД:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = ANY_SEC; SEC_GROUP = <Money>; LIMIT = 82;
IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = SEC_GROUP; CO_SEC_GROUP = <Stocks>;
```

11. Ограничение на клиента на торговлю денежными активами:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = NO_TRADE; SEC_GROUP = <Money>;
```

12. Ограничение на клиента на изменение портфеля не более 20 процентов:

```
ADD RULE: CLIENT_CODE = Q1; RULE_TYPE = DELTA_PORTFOLIO; LIMIT=20;
```

10.5.2 Пример ограничений на группу клиентов

1. Ограничение на группу клиентов на группу инструментов не более 100 000 рублей без учета НКД:

```
ADD RULE: GROUP_CLIENT_CODE = TM1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; VALUE
= 100000; IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE;
```

2. Ограничение на группу клиентов на группу инструментов не более 23 процентов от суммарного объёма обращения по эмитентам:

```
ADD RULE: GROUP_CLIENT_COD E= TM4;RULE_TYPE = SEC_GROUP; SIGN = NOT_MORE; SEC_GROUP
= <StocksCom>; LIMIT = 23; FULL = FREE_FLOAT_BY_GROUP;
```

3. Ограничение на группу клиентов на группу инструментов не более 20 тысяч штук инструментов из группы:

```
ADD RULE: GROUP_CLIENT_CODE = TM4; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SIGN = NOT_MORE; SEC_GROUP
= <StocksPref>; VALUE=20000; FULL=COUNT;
```

Остальные виды ограничений добавляются по примеру ограничений на клиента, приведенных выше.

10.5.3 Пример ограничений на группу (суммарно)

Ограничение на группу (суммарно) на группу инструментов не более 100 000 рублей без учета НКД:

```
ADD RULE: GROUP_CLIENT_CODE = TM1; RULE_TYPE = SEC_GROUP; SEC_GROUP = <Money>; VALUE
= 100000; IGNORE_ACCINT = YES; SIGN = NOT_LOWER; FULL = VALUE; SUMMARY = YES;
```

Остальные виды ограничений добавляются по примеру ограничений на клиента, приведенных выше.

Если во время импорта программа обнаружила несоответствие данных заданным ограничениям, то она выдаст предупреждение в окне «Нарушения ограничений».

10.6 Импорт эталонных портфелей

Импортированный файл с расширением *.dat может содержать строки с денежными позициями и строки с позициями по инструментам.

Структура файла:

Параметр	Назначение
DEPO:	Заголовок строки с отражаемой позицией по инструментам
MONEY:	Заголовок строки с отражаемой денежной позицией
FIRM_ID	Идентификатор участника торгов
SECCODE	Код инструмента
CURR_CODE	Код валюты (для денежных позиций)
CLIENT_CODE	Код клиента
OPEN_BALANCE	Позиция клиента
LIMIT_KIND	Срок расчетов. Если параметр не задан, то срок расчетов равен «Т0»

Пример файла импорта данных:

```
MONEY: FIRM_ID = NC0038900000; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = E2; OPEN_BALANCE =
500,00; LIMIT_KIND = 2;
DEPO: FIRM_ID = NC0038900000; SECCODE = LKOH; CLIENT_CODE = E2; OPEN_BALANCE = 1000;
LIMIT_KIND = 2;
```

> **В качестве разделителя целой и дробной части денежных сумм используется «,».**

10.7 Импорт транзакций

Импорт транзакций предназначен для автоматического ввода в торговую систему поручений (транзакций), подготовленных какой-либо внешней программой, и получения отчета о результате ввода транзакции.

10.7.1 Применение импорта транзакций

Для обмена информацией между TrustManager и внешним приложением используются текстовые файлы фиксированной структуры:

- *.tri – файл с параметрами транзакций;
- *.tro – файл с результатами посылки транзакций в торговую систему;
- *.trr – файл, содержащий журнал обработки транзакций.

Схема взаимодействия между программами выглядит следующим образом:

1. Внешняя программа формирует транзакцию с заданными параметрами и записывает ее в виде новой строки в .tri-файл. Транзакции идентифицируются по дополнительному целочисленному параметру «TRANS_ID», содержащему уникальный номер.
2. Модуль TrustManager с определенной периодичностью опрашивает .tri-файл с параметрами транзакций и передает в торговую систему ранее не обработанные транзакции. Если описание транзакции не соответствует принятому формату, то она отвергается.
3. Результат действий записывается в .tro-файл в формате, пригодном для чтения внешней программой. Каждая строка файла содержит информацию об обработке отдельной транзакции, различаемой по параметру «TRANS_ID».
4. При обработке внешней программой результатов операции (на бирже), выводимых в .tro-файл, регистрационный номер заявки в торговой системе указывается в текстовом сообщении, возвращаемом торговой системой (поле «DESCRIPTION»).

> 1. **Перед первым чтением .tri-файла программа обращается к .tro-файлу и считывает обработанные заявки. Заявки, содержащиеся в .tro-файле, считаются обработанными, и строки в .tri-файле с тем же параметром «TRANS_ID» игнорируются.**
> 2. **Если внешняя программа при каждом запуске начинает нумеровать заявки сначала, то перед ее запуском необходимо удалить .tro-файл из рабочей директории.**

10.7.2 Формат файла с параметрами транзакций (*.tri)

Файл представляет собой последовательность строк, каждая из которых содержит информацию по отдельной транзакции.

Параметры транзакции описываются в виде «НАЗВАНИЕ_ПАРАМЕТРА=значение_параметра» и разделяются символом «;» (точка с запятой). В конце каждой строки должен стоять перевод строки (\0x0D\0x0A).

Параметры и принимаемые ими значения:

Параметр	Назначение
ACTION	Вид транзакции, имеющий одно из следующих значений: _ «NEW_GROUP_ORDER» – новая групповая заявка; _ «NEW_GROUP_STOP_ORDER» – новая групповая стоп-заявка; _ «NEW_GROUP_NEG_DEAL» – новая групповая адресная заявка; _ «KILL_GROUP_ORDER» – снять групповую заявку; _ «KILL_GROUP_STOP_ORDER» – снять групповую стоп-заявку; _ «KILL_GROUP_NEG_DEAL» – снять групповую адресную заявку
CLASSCODE	Код класса, по которому выполняется транзакция (например, «TQBR»). Обязательный параметр при вводе заявок. При снятии заявок не используется
TRANS_ID	Уникальный идентификационный номер заявки
Обязательные параметры, используемые при вводе заявок различных типов	
SECCODE	Код инструмента, по которому выполняется транзакция (например, «RTKM»)
CLIENT_CODE	Код группы клиентов длиной не более 64 символов
TYPE	Тип заявки, только при «ACTION»=«NEW_GROUP_ORDER», при прочих видах транзакций игнорируется. Возможные значения: _ «L» – Лимитированная; _ «M» – Рыночная
OPERATION	Направление заявки. Возможные значения: _ «S» – Продать; _ «B» – Купить
PRICE	Цена заявки, за единицу инструмента. Если в региональных настройках Windows установлен разделитель «,» (запятая), то разделителем целой и дробной части цены может быть указана и «.» (точка) и «,» (запятая). Если в региональных настройках Windows установлен разделитель «.» (точка), то разделителем в цене может быть только «.» (точка)
QUANTITY	Количество лотов в заявке
Необязательные параметры при вводе заявки	
EXECUTION_CONDITION	Условие исполнения заявки. Только для типа «NEW_GROUP_ORDER». Возможные значения: _ «PUT_IN_QUEUE» – поставить в очередь (значение по умолчанию, если параметр не указан); _ «FILL_OR_KILL» – немедленно или отклонить; _ «KILL_BALANCE» – снять остаток

Параметр	Назначение
ORDER_MODE	Тип указания количества. Только для «NEW_GROUP_ORDER». Возможные значения: _ «VALUE» – указывается количество; _ «PART» – указывается доля; _ «PART_ON_ALL» – указывается доля и включается режим «Купить на все средства» Если параметр не указан, то соответствующие режим определяется на основании настроек, задающих режим подачи групповых заявок по умолчанию
ROUND_MODE	Способ округления при разбиении групповой заявки. Возможные значения: _ «KEEP_TOTAL» – округление долей с сохранением суммарного количества; _ «TO_ZERO» – округление долей вниз (к нулю) Если параметр не указан, то тип округления берётся из настроек.
Параметры ввода стоп-заявок	
STOP_ORDER_KIND	Тип стоп-заявки. Может принимать значения: _ «SIMPLE_STOP_ORDER» – стоп-лимит (по умолчанию); _ «CONDITION_PRICE_BY_OTHER_SEC» – с условием по другому инструменту; _ «WITH_LINKED_LIMIT_ORDER» – со связанной заявкой; _ «TAKE_PROFIT_STOP_ORDER» – тейк-профит; _ «TAKE_PROFIT_AND_STOP_LIMIT_ORDER» – тейк-профит и стоп-лимит; _ «ACTIVATED_BY_ORDER_SIMPLE_STOP_ORDER» – стоп-лимит по исполнению заявки; _ «ACTIVATED_BY_ORDER_TAKE_PROFIT_STOP_ORDER» – тейк-профит по исполнению заявки; _ «ACTIVATED_BY_ORDER_TAKE_PROFIT_AND_STOP_LIMIT_ORDER» – тейк-профит и стоп-лимит по исполнению заявки
EXPIRE_DATE	Срок действия стоп-заявки. Может принимать значения: _ «GTC» – до отмены; _ «TODAY» – до окончания текущей торговой сессии (по умолчанию); _ Дата в формате «ГГГГММДД», где «ГГГГ» – год, «ММ» – месяц, «ДД» – день
IS_ACTIVE_IN_TIME	Признак действия заявки типа «тейк-профит и стоп-лимит» в течение определенного интервала времени. Значения «YES» или «NO»
ACTIVE_FROM_TIME	Время начала периода действия стоп-заявки типа «Тейк-профит и стоп-лимит» (в формате ЧЧММСС). Используется только при «IS_ACTIVE_IN_TIME=YES»
ACTIVE_TO_TIME	Время окончания периода действия стоп-заявки типа «Тейк-профит и стоп-лимит» (в формате ЧЧММСС). Используется только при «IS_ACTIVE_IN_TIME=YES»
STOPPRICE	Стоп-цена, за единицу инструмента
STOPPRICE2	Цена условия «стоп-лимит» для стоп-заявок типов «Тейк-профит и стоп-лимит» и «Тейк-профит и стоп-лимит по исполнению»

Параметр	Назначение
OFFSET	Величина отступа от максимума (минимума) цены последней сделки. Только для типов «тейк-профит», «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
OFFSET_UNITS	Единицы измерения отступа: Возможные значения: _ «PERCENTS» – в процентах; _ «PRICE_UNITS» – в параметрах цены Только для типов «тейк-профит», также «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
SPREAD	Величина защитного спреда. Только для типов «тейк-профит», «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
SPREAD_UNITS	Единицы измерения защитного спреда. Возможные значения: _ «PERCENTS» – в процентах; _ «PRICE_UNITS» – в параметрах цены Только для типов «тейк-профит», также «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
MARKET_STOP_LIMIT	Признак исполнения заявки по рыночной цене при наступлении условия «стоп-лимит». Значения «YES» или «NO». Только для типов «тейк-профит», «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
MARKET_TAKE_PROFIT	Признак исполнения заявки по рыночной цене при наступлении условия «тейк-профит». Значения «YES» или «NO». Только для типов «тейк-профит», «тейк-профит и стоп-лимит» и их вариантов «по исполнению»
STOPPRICE_CLASSCODE	Класс инструмента условия. Только для типа «С условием по другому инструменту»
STOPPRICE_SECCODE	Инструмент условия. Только для типа «С условием по другому инструменту»
STOPPRICE_CONDITION	Направление предельного изменения стоп-цены. Только для типа «С условием по другому инструменту». Может принимать значения «>=» или «<=»
LINKED_ORDER_PRICE	Цена связанной лимитированной заявки. Только для типа «Со связанной заявкой»
KILL_IF_LINKED_ORDER_PARTLY_FILLED	Признак снятия стоп-заявки при частичном исполнении связанной лимитированной заявки. Возможные значения: «YES» или «NO» Только для типа «Со связанной заявкой»
BASE_ORDER_KEY	Номер групповой заявки-условия. Только для стоп-заявок «по исполнению»
USE_BASE_ORDER_BALANCE	Признак использования в качестве объема заявки «по исполнению» исполненного количества инструментов заявки-условия. Возможные значения: «YES» или «NO». Только стоп-заявок «по исполнению»
ACTIVATE_IF_BASE_ORDER_PARTLY_FILLED	Признак активации стоп-заявки «по исполнению» при частичном исполнении заявки-условия. Возможные значения: «YES» или «NO». Только для стоп-заявок «по исполнению»

Параметр	Назначение
Параметры ввода адресных заявок	
SETTLE_CODE	Код расчётов
PARTNER	Код организации-партнёра по сделке
REFUNDRATE	Возмещение. Указывается в процентах
MATCHREF	Текстовая ссылка для связки встречных заявок. Необязательный параметр
Параметры снятия групповых заявок различных типов	
ORDER_KEY	Номер снимаемой групповой заявки или групповой адресной заявки
STOP_ORER_KEY	Номер снимаемой групповой стоп-заявки

Примеры строк, которые могут содержаться в .tri-файле:

Транзакция	Строка
Групповая заявка на продажу (Ростелеком, лимитированная, 3 лота по 253.3 руб.)	CLIENT_CODE=GR467; TYPE=L; TRANS_ID=1; CLASSCODE=TQBR; SECCODE=RTKM; ACTION=NEW_GROUP_ORDER; OPERATION=S; PRICE=43,21; QUANTITY=3;
Групповая заявка на покупку (ЛУКОЙЛ, лимитированная, 3 лота по 253.3 руб.)	CLIENT_CODE=GR467; TYPE=L; TRANS_ID=2; CLASSCODE=TQBR; SECCODE=LKOH; ACTION=NEW_GROUP_ORDER; OPERATION=B; EXECUTION_CONDITION=PUT_IN_QUEUE; ROUND_MODE=KEEP_TOTAL;PRICE=253,3; QUANTITY=3;
Групповая стоп-заявка типа «Стоп-лимит» на продажу (Ростелеком, 3 лота по 211.3 руб. при стоп-цене 212 руб.)	CLIENT_CODE=GR467; TRANS_ID=4; CLASSCODE=TQBR; SECCODE=RTKM; ACTION=NEW_GROUP_STOP_ORDER; OPERATION=S; STOPPRICE=212; PRICE=211,3; QUANTITY=3;
Групповая стоп-заявка на покупку типа «Тейк-профит и стоп-лимит» (Русгидро, 300 лотов по цене 2.9, стоп-цена 2,95, цена активации тейк-профита 3, отступ 0, защитный спред 0)	TRANS_ID=45; ACTION=NEW_GROUP_STOP_ORDER; STOP_ORDER_KIND= TAKE_PROFIT_AND_STOP_LIMIT_ORDER; EXPIRE_DATE=GTC; STOPPRICE=2.95; STOPPRICE2=3; OFFSET=0; SPREAD=0; OFFSET_UNITS=PRICE_UNITS; SPREAD_UNITS=PRICE_UNITS; CLASSCODE=TQBR; SECCODE=HYDR; CLIENT_CODE=11; OPERATION=B; ROUND_MODE=KEEP_TOTAL; PRICE=2.9; QUANTITY=300;
Групповая адресная заявка (Покупка 500 лотов Лукойла по цене 2049,0 с кодом расчетов B0, партнер ТЕСТ)	TRANS_ID=39; ACTION=NEW_GROUP_NEG_DEAL; CLASSCODE=BPSEQ; SETTLE_CODE=B0; PARTNER=ТЕСТ; REFUNDRATE=1; SECCODE=LKOH; CLIENT_CODE=11; OPERATION=B; ROUND_MODE=KEEP_TOTAL; PRICE=2049; QUANTITY=500;

Транзакция	Строка
Снятие групповой заявки с номером 34	CLASSCODE=TQBR; SECCODE=RU0009024277; TRANS_ID=5; ACTION=KILL_GROUP_ORDER; ORDER_KEY=34;
Снятие групповой стоп-заявки с номером 105	CLASSCODE=TQBR; TRANS_ID=6; ACTION=KILL_GROUP_STOP_ORDER; ORDER_KEY=105;

10.7.3 Формат файла с результатами обработки транзакций (*.tro)

Файл представляет собой последовательность строк, каждая из которых содержит информацию по отдельной транзакции.

Параметры транзакции описываются в виде «НАЗВАНИЕ_ПАРАМЕТРА=значение_параметра» и разделяются символом «;» (точка с запятой). В конце каждой строки должен стоять перевод строки (\0x0D\0x0A).

> **Групповые заявки нумеруются, начиная с «0» (нуля).**

Параметры и принимаемые ими значения:

Параметр	Назначение
TRANS_ID	Уникальный идентификационный номер заявки
STATUS	Результат выполнения операции. Может принимать одно из следующих значений: _ «0» – транзакция отправлена серверу; _ «3» – транзакция выполнена; _ «5» – транзакция отвергнута; _ «90» – транзакция частично выполнена; _ «99» – неизвестный тип транзакции
TRANS_DESCRIPTION	Описание выполняемой транзакции, например «Ввод групповой заявки»
DESCRIPTION	Текстовый комментарий к полю «STATUS»

10.8 Импорт пулов заявок

10.8.1 Формат файла с параметрами пула заявок

Файл представляет собой последовательность строк. Первая строка файла содержит описание пула и имеет вид:

```
ACTION=NEW_POOL_OF_ORDERS; POOL_ID=<Идентификатор пула, присваиваемый брокером>;
POOL_DESC=<Текстовое описание пула>
```

Далее идут строки с описанием самих заявок. Каждая из таких заявок описывается в отдельной строке.

Параметры заявок описываются в виде «НАЗВАНИЕ_ПАРАМЕТРА=значение_параметра» и разделяются символом «;» (точка с запятой). В конце каждой строки должен стоять перевод строки (\0x0D\0x0A).

Параметры и принимаемые ими значения:

Параметр	**Назначение**
ACTION	Вид транзакции, имеет значение «NEW_ORDER_IN_POOL» – новая заявка в пуле
ORDER_TYPE	Тип заявки. Значение «NORMAL».
CLIENT_CODE	Код клиента длиной не более 12 символов, обязательный параметр при подаче новых заявок
CLASSCODE	Код класса, по которому выполняется транзакция (например, «TQBR»). Обязательный параметр
SECCODE	Код инструмента, по которому выполняется транзакция (например, «RTKM»)
PRICE	Цена заявки, за единицу инструмента. Обязательный параметр. Если в региональных настройках Windows установлен разделитель «,» (запятая), то разделителем целой и дробной части цены может быть указана и «.» (точка) и «,» (запятая). Если в региональных настройках Windows установлен разделитель «.» (точка), то разделителем в цене может быть только «.» (точка)
QUANTITY	Количество лотов в заявке, обязательный параметр при подаче новых заявок
OPERATION	Направление заявки, обязательный параметр при подаче новой заявки. Возможные значения: _ «S» – Продать; _ «B» – Купить
TYPE	Тип заявки. Возможные значения: _ «L» – Лимитированная; _ «M» – Рыночная

Пример:

```
ACTION=NEW_POOL_OF_ORDERS; POOL_ID=AAV100; POOL_DESC=4 пул
```

```
ACTION=NEW_ORDER_IN_POOL; ORDER_TYPE=NORMAL; CLIENT_CODE=E3; CLASSCODE=BQUOTE;
SECCODE=EESR; PRICE=30; QUANTITY=7; OPERATION=S; TYPE=L
ACTION=NEW_ORDER_IN_POOL; ORDER_TYPE=NORMAL; CLIENT_CODE=E3; CLASSCODE=BQUOTE;
SECCODE=EESR; PRICE=29.95; QUANTITY=7; OPERATION=B; TYPE=L
ACTION=NEW_ORDER_IN_POOL; ORDER_TYPE=NORMAL; CLIENT_CODE=E4; CLASSCODE=BQUOTE;
SECCODE=RU0009029540; PRICE=90001; QUANTITY=1; OPERATION=S; TYPE=L
```

10.8.2 Формат файла с результатами импорта пулов

Файл с результатами импорта пулов содержит информацию об импорте (попытках импорта) пулов заявок. Также в него попадает информация о снятии пулов. При работе с данным файлом TrustManager не держит его открытым непрерывно, а открывает его на запись только при необходимости добавления новой записи и немедленно закрывает сразу после этого. Это даёт возможность внешней программе брокера периодически очищать или удалять данный файл. При успешном импорте пула в файл добавляется следующая строка:

```
[ДД.ММ.ГГГГ ЧЧ:ММ:СС:МИЛ] POOL_ID=<Идентификатор пула, присвоенный брокером>;
STATUS=IMPORTED; INT_POOL_ID=<Внутренний уникальный идентификатор пула>;
POOL_DESC=<Текстовое описание пула>; IMPORTED_ORDERS=<Количество успешно
импортированных заявок в составе пула>; ERROR_ORDERS=<Количество заявок не
импортированных из-за ошибочных данных в их составе>; TOTAL_ORDERS=<Всего обработано
заявок в файле импорта>
```

При невозможности импорта пула в файл добавляется следующая запись:

```
[ДД.ММ.ГГГГ ЧЧ:ММ:СС:МИЛ] POOL_ID=<Идентификатор пула, присвоенный брокером>;
STATUS=REJECTED; ERROR_CODE=<Код ошибки>; REASON=<Описание причины>
```

При снятии пула заявок по команде пользователя добавляется запись:

```
[ДД.ММ.ГГГГ ЧЧ:ММ:СС:МИЛ] POOL_ID=<Идентификатор пула, присвоенный брокером>;
STATUS=KILLED; INT_POOL_ID=<Внутренний уникальный идентификатор пула>
```

При этом начало каждой строки имеет метку о текущей дате и времени фиксированной длины и фиксированного формата. Здесь «МИЛ» это миллисекунды. Коды ошибок при импорте:

- «1» – неверный формат файла; если при этом не удалось обнаружить идентификатор пула, то он считается равным строке «UNKNOWN»;

- «2» – такой идентификатор пула уже использовался ранее;
- «3» – не выполнено условие уникальности данных в пуле.

10.9 Импорт описаний рейтинговых агентств

10.9.1 Формат файла с данными по рейтинговым агентствам

1. Секция [AgencyInfo] содержит данные по рейтинговым агентствам в формате:

```
[AgencyInfo]
<Код агентства>=<Наименование агентства>
```

Где, в поле <Код агентства> допускается вводить только латинские символы. Например:

```
M=Moody’s
```

2. Секция [Ratings] содержит рейтинги и задается в виде:

```
[Ratings_<Код агентства>_<Тип рейтинга>]
```

или

```
[Ratings_<Код агентства>]
```

Где:

- <Код агентства> – код, указанный в секции [AgencyInfo];
- <Тип рейтинга>. Возможные значения:
  - «0» – международный рейтинг;
  - «1» – национальный рейтинг.

  Если тип рейтинга не указан, то он считается международным.

Секция принимает вид:

```
[Ratings]
<Номер в шкале>=<Рейтинг>
```

Где:

- <Номер в шкале> – порядковый номер рейтинга в пределах шкалы (0 – наивысший), используется для упорядочения рейтингов;
- <Рейтинг> – рейтинг.

Например:

```
0=Aaa
```

Пример файла:

```
[AgencyInfo]
;список агентств
SP=Standard and Poor's
M=Moody's
F=Fitch Ratings
ERA=Эксперт РА
NRA=Национальное Рейтинговое Агентство
АКМ=Анализ, Консультации и Маркетинг
RR=Рус-Рейтинг

[Ratings_SP_0]
;Standard and Poor's; международные рейтинги
0=AAA
1=AA+
2=AA
3=AA-
4=A+
5=A
6=A-
7=BBB+
8=BBB
9=BBB-
10=BB+
11=BB
12=BB-
13=B+
14=B
15=B-
16=CCC+
17=CCC
18=CCC-
19=CC

[Ratings_SP_1]
```

```
;Standard and Poor's; национальные рейтинги
0=ruAAA
1=ruAA+
2=ruAA
3=ruAA-
4=ruA+
5=ruA
6=ruA-
7=ruBBB+
8=ruBBB
9=ruBBB-
10=ruBB+
11=ruBB
12=ruBB-
13=ruB+
14=ruB
15=ruB-
16=ruCCC+
17=ruCCC
18=ruCCC-
19=ruC
```

10.9.2 Формат файла с рейтингами

1. Секция [Emitents] содержит рейтинги на эмитентов в формате:

```
<Код эмитента>=<Код агентства>, <Тип рейтинга>, <Рейтинг>
```

Где:

- <Код эмитента> – код эмитента, совпадающий с кодом эмитента из номера государственной регистрации инструмента (описание формирования кода эмитента приведено в п. Формирование кода эмитента);
- <Код агентства>, <Тип рейтинга>, <Рейтинг> – описание параметров см. в п. 10.9.1.

2. Секция [Securities] содержит рейтинги по конкретным инструментам в формате:

```
<Код инструмента>=<Код агентства>, <Тип рейтинга>, <Рейтинг>
```

Где:

- <Код инструмента> – код инструмента;
- <Код агентства>, <Тип рейтинга>, <Рейтинг> – описание параметров см. в п. 10.9.1.

Пример файла:

```
[Emitents]
00010=SP,0,AAA

[Securities]
ALTF=SP,0,AAA
```

Рейтинг инструмента имеет более высокий приоритет, чем рейтинг эмитента.

10.10 Файл с параметрами айсберг-заявок

Файл содержит секцию [IcebergRestrictions] со значениями видимого количества для инструментов в формате:

```
<Код инструмента>=<Минимальное значение видимого количества в лотах>
```

Чтобы задать минимальное количество для кодов инструментов, не перечисленных в секции, в качестве <Кода инструмента> укажите значение «<ALL>» (это значение может быть указано только один раз).

Если для кода инструмента значение минимального количества не задано индивидуально, а также отсутствует строка со значением «<ALL>», то считается, что для инструмента не задано ограничение на минимальное значение видимого количества.

Если файл не задан в настройке «Загружать параметры инструментов» (см. п. 9.5.4), то минимальное видимое количество для классов Московской биржи равно 100 лотам, а для других классов не задано. Если файл выбран, но пуст, то минимальное видимое количество не задано для всех инструментов.

Пример:

```
[IcebergRestrictions]
<ALL>=100
LKOH=150
SBER=50
```

11.Формирование кода эмитента

Код эмитента определяется по государственному регистрационному номеру (ГРН), который транслируется только Московской Биржей. Для инструментов, торгуемых на других площадках, код эмитента не может быть определен.

В зависимости от типа инструмента ГРН имеет различный формат. Для анализа кода эмитента учитываются буквы и цифры, и если в номере присутствуют разделители (пробелы или минусы), то они не учитываются.

11.1 Эмиссионные бумаги, требующие регистрации

11.1.1 Основной выпуск

Номер ГРН имеет вид:

```
1 – 2 3 – 4 5 6 7 8 – 9
```

При этом часть номера «4 5 6 7 8 – 9» задаёт уникальный код эмитента. Таким образом, если у инструментов в ГРН совпадают позиции «4 5 6 7 8 – 9», то такие инструменты относятся к одному эмитенту.

Часть номера «2 3» задаёт порядковый номер выпуска бумаги. Если инструмент имеет несколько выпусков, то у таких инструментов совпадает код эмитента, совпадает часть номера «1» (содержит тип инструмента), но может отличаться часть «2 3» и, при наличии, часть «10 11 12 13» (в ней задаётся номер дополнительного выпуска инструмента).

Для определения кода эмитента учитываются номера, имеющие букву в части номера «9». Прочие номера данного формата игнорируются.

Пример

ГРН для МБ ФР: А1 Облигации Мосэнерго2: 4-03-00085-А

ГРН для МБ ФР: А1 Облигации Мосэнерго3: 4-04-00085-А

ГРН для МБ ФР: Т+А1 Акции и паи внесписочные +МосЭнерго: 1-01-00085-А

Код эмитента всех этих инструментов: 00085А.

11.1.2 Дополнительный выпуск

Номер ГРН имеет вид:

```
1 – 2 3 – 4 5 6 7 8 – 9 – 10 11 12 13
```

Часть номера «4 5 6 7 8 – 9» задаёт уникальный код эмитента. Часть номера «10 11 12 13» задаёт номер дополнительного выпуска.

11.2 Эмиссионные бумаги, не требующие регистрации

11.2.1 Основной выпуск

Номер ГРН имеет вид:

```
1 2 3 4 – 5 6 – 7 8 9 10 11 – 12
```

Часть номера «7 8 9 10 11 - 12» задаёт код эмитента.

Для определения кода эмитента учитываются номера, имеющие «В» в части номера «2». Прочие номера данного формата игнорируются.

Пример

ГРН для МБ ФР: А1 Облигации ЗапСибБ01: 4В020100918В

ГРН для МБ ФР: А1 Облигации ЗапСибБ02: 4В020200918В

Код эмитента этих инструментов: 00918В

11.2.2 Дополнительный выпуск

Номер ГРН имеет вид:

```
1 2 3 4 – 5 6 – 7 8 9 10 11 – 12 – 13 14 15 16
```

Часть номера «7 8 9 10 11 - 12» задаёт код эмитента. Часть номера «13 14 15 16» задаёт номер дополнительного выпуска.

11.3 Ценные бумаги субъектов РФ и муниципальные ЦБ

Номер ГРН имеет вид:

```
1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11
```

Для определения кода эмитента учитываются номера, символы «1 2» которых равны «RU». В номере такого типа кодом эмитента являются символы «8 9 10». Часть номера «5 6 7» задаёт номер выпуска инструмента.

Пример

ГРН для облигации Министерства финансов Самарской области: RU25004SAM0

Код эмитента: SAM

11.4 Облигации ЦБ РФ

Номер ГРН имеет вид:

```
1 – 2 3 – 4 5 6 7 8 – 9
```

Для определения кода эмитента учитываются номера, имеющие значение «4» в символе «1» и значение «BR» в символах «6 7». Кодом эмитента является строка «BR», номер выпуска задаёт часть номера «2 3».

11.5 Облигации федерального займа

Номер ГРН имеет вид:

```
1 2 3 4 5 6 7 8 9
```

Для определения кода эмитента учитываются номера, имеющие значение «2» в символе «1» и значение «RMFS» в символах «6 7 8 9». Кодом эмитента является строка «RMF», номер выпуска задаёт часть номера «3 4 5».

12.Хранимые процедуры

12.1 Добавление клиента в группу

Хранимая процедура **TM_AddClientToGroup** предназначена для добавления клиента в группу.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@GroupCode	VARCHAR(64)	Код группы, в которую будет добавляться клиент
@ClientCode	VARCHAR(20)	Код добавляемого клиента
@Weight	INT	Пропорциональная доля клиента в группе. Если используется фиксированное разбиение, то объем групповой заявки делится пропорционально заданным долям
@Comment	VARCHAR(255)	Текстовый комментарий
@GroupId	INT	Выходной параметр, в который передается идентификатор группы, в которую добавили клиента
@ClientNum	INT	Выходной параметр, в который передается номер добавленного клиента в группе

12.2 Удаление клиента из группы

Хранимая процедура **TM_DeleteClientFromGroup** предназначена для удаления клиента из группы.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@GroupCode	VARCHAR(64)	Код группы, из которой клиент удаляется
@ClientCode	VARCHAR(20)	Код удаляемого клиента
@Success	INT	Выходной параметр, Возможные значения: _ «0» – клиент не удален; _ «1» – клиент успешно удален

12.3 Удаление группы клиентов

Хранимая процедура **TM_DeleteGroup** предназначена для удаления группы клиентов.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@GroupCode	VARCHAR(64)	Код удаляемой группы
@ClientCode	VARCHAR(20)	Код удаляемого клиента
@Success	INT	Выходной параметр, Возможные значения: _ «0» – группа не удалена; _ «1» – группа успешно удалена

> **Хранимая процедура TM_DeleteGroup не удаляет группу клиентов из таблицы БД, а просто запрещает ее использование (чтобы при удалении группы не удалять связанные с ней записи из других таблиц БД).**

12.4 Добавление группы инструментов

Хранимая процедура **CreateNewSecGroup** предназначена для создания группы инструментов.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@SecGroupCode	VARCHAR(64)	Код группы инструментов, содержащий только латинские буквы и цифры
@SecGroupName	VARCHAR(255)	Наименование группы инструментов
@ModeLogicalAnd	INT	Параметр управляет режимом группировки элементов группы. Возможные значения: _ «0» – группой инструментов считается объединение элементов группы; _ «1» – группой инструментов считается пересечение элементов группы
@ModeRatings	INT	Возможные значения: _ «0» – группа инструментов не основана на рейтингах по эмитентам или отдельным инструментам; _ «1» – группа инструментов основана на рейтингах по эмитентам или отдельным инструментам
@RAgencies	INT	Параметр содержит минимальное количество требуемых рейтинговых агентств, если группа основана на рейтингах

Параметр	Тип данных	Значение
		(@ModeRatings=1), иначе должно быть равен «-1»
@ListLevel	INT	Уровень листинга. Возможные значения: _ «0» – в Таблице текущих торгов данный параметр отсутствует; _ «1» / «2» / «3» – уровень листинга из Таблицы текущих торгов; _ <пусто> – уровень листинга не учитывается
@SecGroupID	INT, OUTPUT	Возвращает идентификатор созданной группы инструментов или «-1», в случае неудачи

После создания группы инструментов необходимо создать элементы этой группы инструментов. Для этого применяется хранимая процедура CreateNewSecGroupMember.

> **Параметры @ModeLogicalAnd=1 и @ModeRatings=1 не могут быть указаны одновременно.**

Примеры добавления новой группы инструментов:

1. Режим – объединение без использования рейтингов:

```
DECLARE SecGroupID int

EXEC CreateNewSecGroup
@SecGroupCode = TEST_A1_AC222,
@SecGroupName = "Пример группы инструментов",
@ModeLogicalAnd = 0,
@ModeRatings = 0,
@RAgencies = -1,
@ListLevel = 1,
@SecGroupID = @SecGroupID OUTPUT

PRINT @SecGroupID

GO
```

2. Режим – объединение с использованием рейтингов:

```
DECLARE @SecGroupID int

EXEC CreateNewSecGroup
@SecGroupCode = TEST_03,
```

```
@SecGroupName = "Основана на рейтингах",
@ModeLogicalAnd = 0,
@ModeRatings = 1,
@RAgencies = 0,
@ListLevel = -1,
@SecGroupID = @SecGroupID OUTPUT
PRINT @SecGroupID;

GO
```

12.5 Изменение параметров группы инструментов

Хранимая процедура **ModifySecGroup** предназначена для редактирования некоторых параметров существующей группы инструментов. В случае изменения только членов группы инструментов данную процедуру вызывать не требуется.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@SecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, в которую вносятся изменения
@SecGroupName	VARCHAR(255)	Наименование группы инструментов
@ModeLogicalAnd	INT	Параметр управляет режимом группировки элементов группы. Возможные значения: _ «0» – группой инструментов считается объединение элементов группы; _ «1» – группой инструментов считается пересечение элементов группы Значение не может быть изменено для групп инструментов с параметром @ModeRatings=1
@ListLevel	INT	Уровень листинга. Возможные значения: _ «0» – в Таблице текущих торгов данный параметр отсутствует; _ «1» / «2» / «3» – уровень листинга из Таблицы текущих торгов; _ <пусто> – уровень листинга не учитывается
@Success	INT, OUTPUT	Результат изменения параметров группы инструментов. Возможные значения: _ «0» – не успешно; _ «1» – успешно

Пример вызова хранимой процедуры:

```
DECLARE @Success int

EXEC ModifySecGroup
@SecGroupID = 32,
@SecGroupName = TEST_020,
@ModeLogicalAnd = 1,
@ListLevel = 2,
@Success = @Success OUTPUT

PRINT @Success

GO
```

12.6 Удаление группы инструментов

> **Перед удалением группы инструментов необходимо удалить все ограничения, которые используют данную группу инструментов.**

Хранимая процедура **DeleteSecGroup** предназначена для удаления указанной группы инструментов. Если группа инструментов используется в ограничении, удаление невозможно.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@SecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, которую требуется удалить
@Success	INT, OUTPUT	Результат удаления группы инструментов. Возможные значения: – «0» – не успешно; – «1» – успешно

Пример вызова хранимой процедуры:

```
DECLARE @Success int

EXEC DeleteSecGroup
@SecGroupID = 24,
@Success = @Success OUTPUT

PRINT @Success
```

```
GO
```

12.7 Добавление элемента в группу инструментов

Хранимая процедура **CreateNewSecGroupMember** предназначена для добавления элемента в существующую группу инструментов.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@SecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, в которую добавляется элемент
@MemberType	CHAR(1)	Тип члена группы. Возможные значения: _ «S» – инструмент; _ «C» – класс инструментов; _ «G» – группа инструментов; _ «E» – все инструменты, кроме указанной группы инструментов; _ «R» – рейтинг от некоторого рейтингового агентства
@MemberCode	VARCHAR(20)	Код члена группы. Возможные значения: _ для типа «S» – код инструмента; _ для типа «C» – код класса инструментов; _ для типа «R» – код агентства; _ для прочих типов – ''
@MemberClass	VARCHAR(20)	Класс члена группы. Возможные значения: _ для типа «S» – код класса инструментов (в который входит инструмент), _ для типа «R» – рейтинг, _ для прочих типов – ''
*@MemberID	INT	Идентификатор члена группы. Возможные значения: _ для типа «G» и «E» – идентификатор группы инструментов; _ для типа «R» – тип шкалы («0» для международной, «1» для национальной); _ для прочих типов указывается «-1»
@Success	INT, OUTPUT	Результат добавления элемента в группу. Возможные значения: _ «0» – не успешно; _ «1» – успешно

* – для указания в качестве члена группы инструментов некоторую предопределённую группу инструментов необходимо указывать в качестве @MemberID идентификатор соответствующей предопределённой группы (см. п. 13.3)

Примеры вызова хранимой процедуры:

1. Добавление нового класса инструментов:

```
DECLARE @Success int

EXEC CreateNewSecGroupMember
@SecGroupID = 35,
@MemberType = C,
@MemberCode = TQBR,
@MemberClass = '',
@MemberID = -1,
@Success = @Success OUTPUT

PRINT @Success

GO
```

2. Добавление нового инструмента:

```
DECLARE @Success int

EXEC CreateNewSecGroupMember
@SecGroupID = 35,
@MemberType = S,
@MemberCode = LKOH,
@MemberClass = TQBR,
@MemberID = -1,
@Success = @Success OUTPUT

PRINT @Success

GO
```

12.8 Удаление элемента из группы инструментов

Хранимая процедура **DeleteSecGroupMember** предназначена для удаления элемента из существующей группы инструментов.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@SecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, из которой удаляется элемент
@MemberType	CHAR(1)	Тип члена группы. Возможные значения: _ «S» – инструмент; _ «C» – класс инструментов; _ «G» – группа инструментов; _ «E» – все инструменты, кроме указанной группы инструментов; _ «R» – рейтинг от некоторого рейтингового агентства
@MemberCode	VARCHAR(20)	Код члена группы. Возможные значения: _ для типа «S» – код инструмента; _ для типа «C» – код класса инструментов; _ для типа «R» – код агентства; _ для прочих типов – ''
@MemberClass	VARCHAR(20)	Класс члена группы. Возможные значения: _ для типа «S» – код класса инструментов (в который входит инструмент); _ для типа «R» – рейтинг; _ для прочих типов – ''
@MemberID	INT	Идентификатор члена группы. Возможные значения: _ для типа «G» и «E» – идентификатор группы инструментов; _ для типа «R» – тип шкалы («0» для международной, «1» для национальной); _ для прочих типов указывается «-1»
@Success	INT, OUTPUT	Результат удаления элемента из группы. Возможные значения: _ «0» – не успешно; _ «1» – успешно

Пример вызова хранимой процедуры:

```
DECLARE @Success int

EXEC DeleteSecGroupMember
@SecGroupID = 2,
@MemberType = C,
@MemberCode = TQNL,
```

```
@MemberClass = '',
@MemberID = -1,
@Success = @Success OUTPUT

PRINT @Success

GO
```

12.9 Добавление ограничения

> **Перед добавлением ограничения необходимо создать группы инструментов для использования в данном ограничении.**

Хранимая процедура **CreateNewRestriction** предназначена для создания ограничения. Для добавления нового ограничения требуется наличие групп инструментов, которые будут использоваться в данном ограничении.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@OnClient	INT	Задание ограничения. Возможные значения: – «0» – ограничение на группу клиентов; – «1» – на одного клиента
@ClientCode	VARCHAR(64)	Код клиента (или код группы клиентов для @OnClient=0)
@RestrType	INT	Тип ограничения. Возможные значения: – «0» – отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости портфеля; – «1» – отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости другой группы инструментов; – «2» – оценка стоимости группы инструментов; – «3» – отношение оценки стоимости группы инструментов к полному объёму обращения этой группы инструментов; – «4» – отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости портфеля; – «5» – отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости другой группы инструментов; – «6» – оценка стоимости любого инструмента; – «7» – количество инструментов (в штуках) из некоторой группы инструментов; – «8» – запрет на проведение операций с инструментами из группы инструментов; – «9» – ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (абсолютное значение); – «10» – ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (на величину доли от оценки эталонного портфеля);

Параметр	Тип данных	Значение
		_ «11» – отношение оценки стоимости инструментов любого эмитента к стоимости портфеля; _ «12» – отношение оценки стоимости инструментов любого эмитента к стоимости другой группы инструментов; _ «13» – оценка стоимости инструментов любого эмитента
@Sign	CHAR(1)	Направление ограничения. Возможные значения: _ «<» – для ограничения сверху; _ «>» – для ограничения снизу
@Limit	FLOAT	Величина ограничения. Если величина ограничения должна задаваться в процентах, то в параметре @Limit указывается доля, а не проценты. Например, для задания ограничения в 12%, @Limit = 0.12
@SecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, к которой применимо ограничение
@CoSecGroupID	INT	Идентификатор группы инструментов, по отношению к стоимости которой применимо ограничение
@ModeSummary	INT	Параметр для ограничений на группу клиентов. Возможные значения: _ «0» – ограничение применяется к индивидуальным активам клиентов этой группы клиентов; _ «1» – ограничение применяется к суммарным активам группы клиентов
@NotUseAccInt	INT	Учет НКД. Возможные значения: _ «0» – НКД учитывается; _ «1» – НКД не учитывается в расчётах Параметр не имеет смысла для ограничений типа «7»
@ModeEmitent	INT	Объем обращения. Возможные значения: _ «0» – объём обращения по конкретному инструменту; _ «1» – объём обращения по эмитенту Параметр имеет смысл для ограничений типа «3»
@ModeAnySecurity	INT	Параметр используется для ограничений типа «4», «5», «6» по любому инструменту. Возможные значения: _ «0» – ограничение по любому инструменту; _ «1» – ограничение по любому инструменту из группы инструментов, указанной в параметре @SecGroupID
@ModeAnyEmitent	INT	Параметр используется для ограничений типа «11», «12», «13» по любому эмитенту. Возможные значения: _ «0» – ограничение по любому инструменту (с группировкой по эмитентам); _ «1» – ограничение по любому инструменту из группы инструментов, указанной в параметре @SecGroupID, также с группировкой по эмитентам
@ID	INT, OUTPUT	Возвращает идентификатор созданного ограничения или «-1»,

Параметр	Тип данных	Значение
		в случае ошибки создания ограничения
@LimitKind	INT	Срок расчетов, к которому применяется ограничение. Если ограничение должно применяться ко всем видам лимитов, укажите значение параметра равным «-1»
@RestrCode	VARCHAR(12)	Уникальный код ограничения
@RestrName	VARCHAR(50)	Наименование ограничения

Примеры вызова хранимой процедуры **CreateNewRestriction** для каждого типа ограничения приведены в п. 13.4.

12.10 Изменение ограничения

Хранимая процедура **EditRestriction** предназначена для редактирования параметров существующего ограничения.

Параметры хранимой процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@ID	INT	Идентификатор ограничения, которое необходимо изменить
@RestrType *	INT	Тип ограничения. Возможные значения: – «0» – отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости портфеля; – «1» – отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости другой группы инструментов; – «2» – оценка стоимости группы инструментов; – «3» – отношение оценки стоимости группы инструментов к полному объёму обращения этой группы инструментов; – «4» – отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости портфеля; – «5» – отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости другой группы инструментов; – «6» – оценка стоимости любого инструмента; – «7» – количество инструментов (в штуках) из некоторой группы инструментов; – «8» – запрет на проведение операций с инструментами из группы инструментов; – «9» – ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (абсолютное значение); – «10» – ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (на величину доли от оценки эталонного портфеля); – «11» – отношение оценки стоимости инструментов любого эмитента к стоимости портфеля; – «12» – отношение оценки стоимости инструментов

Параметр	Тип данных	Значение
		любого эмитента к стоимости другой группы инструментов; _ «13» – оценка стоимости инструментов любого эмитента
@Sign **	CHAR(1)	Направление ограничения. Возможные значения: _ «<» – для ограничения сверху; _ «>» – для ограничения снизу
@Limit **	FLOAT	Величина ограничения
@SecGroupID**	INT	Идентификатор группы инструментов, к которой применимо ограничение
@NoCheck	INT	Параметр используется для временного исключения ограничения из проверки. Возможные значения: _ «0» – не исключать; _ «1» – исключить
@Res	INT, OUTPUT	Результат изменения ограничения. Возможные значения: _ «0» – не успешно; _ «1» – успешно
@LimitKind	INT	Срок расчетов, к которому применяется ограничение. Если ограничение должно применяться ко всем видам лимитов, укажите значение параметра равным «-1»
@RestrCode	VARCHAR(12)	Уникальный код ограничения
@RestrName	VARCHAR(50)	Наименование ограничения

* – значение параметра должно совпадать со значением, указанным при создании ограничения (тип ограничения не может изменяться)

** – заполняются новыми значениями соответствующих параметров. Если параметр не требуется изменить – NULL.

Пример вызова хранимой процедуры:

```
DECLARE      @Res int

EXEC   EditRestriction
@ID = 9,
@RestrType = 3,
@Sign = ">",
@Limit = 11111,
@SecGroupID = 2147418117,
@Res = @Res OUTPUT,
@NoCheck = 1,
```

```
@LimitKind = 1,
@RestrCode = 155,
@RestrName = 'pos'


PRINT @Res

GO
```

12.11 Удаление ограничения

Хранимая процедура **DeleteRestriction** предназначена для удаления существующего ограничения.

Параметры процедуры:

Параметр	Тип данных	Значение
@ID	INT	Идентификатор ограничения, которое необходимо удалить
@Res	INT, OUTPUT	Результат удаления ограничения. Возможные значения: _ «0» – не успешно; _ «1» – успешно

Пример вызова хранимой процедуры:

```
DECLARE      @Res int

EXEC   DeleteRestriction
@ID = 7,
@Res = @Res OUTPUT

PRINT @Res

GO
```

13.Приложения

13.1 Миграция данных из MS SQL в PostgreSQL

Для переноса данных из существующей базы данных на MS SQL в новую базу данных на PostgreSQL предусмотрена возможность миграции данных. Минимальная версия MS SQL, доступная для миграции базы данных: 29.

Для миграции данных используется консольное приложение tm_db_migrate.exe (без графического интерфейса). Программа будет подключаться к исходному ODBC-источнику MS SQL, считывать данные и переносить их в целевой ODBC-источник PostgreSQL. Настройки обоих ODBC-источников указываются в конфигурационном файле tm_migrate.ini, который необходимо разместить в директории приложения (описание настроек см. в п. 13.1.1). Информация о ходе миграции данных выводится в лог-файл tm_db_migrate.log (все сообщения приложения) и в консоль (информация о количестве перенесенных строк и неверных настройках приложения).

При миграции данных построчно копируется содержимое таблиц в следующем порядке: SystemData, GroupDesc, Clients, GroupOrders, Orders, SecGroups, SecGrMemb, SecMinQt, ImportLog, LoadedPositions, RatingAgencies, RatingScales, LoadedSecurities, LoadedSecuritiesClientPrices, Restrictions, PoolOrders, OrdersInPool, GroupStopOrders, StopOrders, GroupNegOrders, NegOrders, ExportOrder.

13.1.1 Формат файла tm_migrate.ini

Секция [DBSource]
В секции задаются данные исходного ODBC-источника, из которого будут переноситься данные. Обязательна для заполнения.

- **db_connection_name** – название ODBC источника. Обязательный параметр.
- **db_connection_login** – логин для аутентификации в базе данных. Обязательный параметр.
- **db_schema** – название схемы, используемой в базе данных. Значение по умолчанию: «» (пусто – каждый источник ODBC как схема по умолчанию).

Секция [DBDestination]
В секции задаются данные целевого ODBC-источника, в который будут переноситься данные. Обязательна для заполнения.

- **db_connection_name** – название ODBC источника. Обязательный параметр.
- **db_connection_login** – логин для аутентификации в базе данных. Обязательный параметр.

- **db_schema** – название схемы, используемой в базе данных. Значение по умолчанию: «» (пусто – каждый источник ODBC как схема по умолчанию).

13.2 Ограничения на минимальный объем заявок

Для групповых заявок можно указать минимальный объем биржевых заявок по классам и инструментам. Это позволяет исключить подачу транзакций на выставление биржевых заявок в случае, если их объем оказался меньше заданной величины в процессе распределения групповой заявки. Объем исключенных заявок распределяется между заявками остальных клиентов.

Ограничения задаются в файле с расширением ini. Путь к данному файлу указывается в настройке MinBuySellValueRestrictionsFile секции [TrustManager] основного конфигурационного файла Рабочего места QUIK — info.ini.

В файле с ограничениями перечисляются минимальные объемы для заявок, заданные по классам и инструментам в следующем формате:

```
[Код класса]
MINVAL=<минимальный объем по заявкам для класса на покупку и продажу>
<Код инструмента>=<минимальный объем по заявкам для указанного инструмента на покупку и продажу>
```

13.3 Идентификаторы предопределенных групп инструментов

Идентификатор группы	Наименование группы
2147418113	Денежные активы
2147418114	Все акции
2147418115	Все облигации
2147418117	Обыкн. акции
2147418118	Привил. Акции
2147418119	Корп. Облигации
2147418120	Муниц. Облигации
2147418121	Бирж. облигации
2147418122	МФО облигации
2147418123	Облигации ЦБ

Идентификатор группы	Наименование группы
2147418124	Облигации РФ
2147418125	Обл. субъектов РФ
2147418126	ПИФы открытые
2147418127	ПИФы закрытые
2147418128	ПИФы интервальные
2147418129	РДР
2147418130	Иностранные фонды
0x7FFF0013	Товарные инструменты

13.4 Примеры вызова хранимой процедуры CreateNewRestriction

Отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости портфеля («0»)

- на одного клиента:

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 0,
@Sign = "<",
@Limit = 0.01,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 1,
@LimitKind = 2,
@RestrCode = 547,
@RestrName = 'pos'

PRINT @ID

GO
```

- на группу клиентов:

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 0,
@ClientCode = TM_01,
@RestrType = 0,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = -1,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@RestrCode = 547,
@RestrName = 'pos'
```

```
PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости группы инструментов к стоимости другой группы инструментов («1»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 1,
@Sign = ">",
@Limit = 0.01,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = 2147418128,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@LimitKind = 2,
@RestrName = 'pos'


PRINT @ID

GO
```

Оценка стоимости группы инструментов («2»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 2,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@LimitKind = 2,
@RestrCode = 547
```

```
PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости группы инструментов к полному объёму обращения этой группы инструментов («3»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 3,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeEmitent = 0,
@RestrName = 'pos'


PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости портфеля («4»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 4,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = -1,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeEmitent = 0,
```

```
@RestrCode = 547


PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости любого инструмента к стоимости другой группы инструментов («5»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 5,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = 2147418122,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeEmitent = 0

PRINT @ID

GO
```

Оценка стоимости любого инструмента («6»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 6,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeEmitent = 0
```

```
PRINT @ID

GO
```

Количество инструментов (в штуках) из некоторой группы инструментов («7»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 7,
@Sign = ">",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0

PRINT @ID

GO
```

Запрет на проведение операций с инструментами из группы инструментов («8»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 8,
@Sign = "<",
@Limit = 12,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0

PRINT @ID

GO
```

Ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (абсолютное значение) («9»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 9,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = -1,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0

PRINT @ID

GO
```

Ограничение на отклонение портфеля от эталонного значения (на величину доли от оценки эталонного портфеля) («10»)

```
DECLARE      @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 10,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = -1,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0

PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости инструментов любого эмитента к стоимости портфеля («11»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 11,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeAnyEmitent = 1

PRINT @ID

GO
```

Отношение оценки стоимости инструментов любого эмитента к стоимости другой группы инструментов («12»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 12,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = 2147418120,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeAnyEmitent = 1

PRINT @ID

GO
```

Оценка стоимости инструментов любого эмитента («13»)

```
DECLARE       @ID int

EXEC   CreateNewRestriction
@OnClient = 1,
@ClientCode = Q2,
@RestrType = 13,
@Sign = "<",
@Limit = 123,
@SecGroupID = 2147418114,
@CoSecGroupID = -1,
@ID = @ID OUTPUT,
@NotUseAccInt = 0,
@ModeAnyEmitent = 1

PRINT @ID

GO
```