



Терминальный модуль риск-менеджера «CoLibri»

Руководство пользователя

Версия 4.7

The logo for quik, consisting of the word "quik" in a white, lowercase, sans-serif font, centered within a solid green circle.

quik

Содержание

1. Общие сведения	2
1.1 Возможности программы	2
1.2 Принципы работы с программой	2
1.3 Основные окна и пункты меню программы	3
1.4 Подготовка к работе	5
2. Таблица «Заявки на перенос позиций»	6
3. Изменения статусов клиентов	10
4. Калькулятор	12
5. Основные функции программы	14
5.1 Режим Margin Call	14
5.2 Перенос позиций	19
5.3 Заккрытие позиций	25
6. Настройки программы	29
6.1 Параметры рассылки оповещений	29
6.2 Перенос позиций	34
6.3 Заккрытие позиций	37
7. ПРИЛОЖЕНИЕ	41
7.1 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и электронных адресов	41
7.2 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и UID	41
7.3 Формат списка клиентов для переноса / закрытия позиций	42
7.4 Формат файла с шаблонами ставок РЕПО	42
7.5 Формат таблицы базы данных для сохранения отосланных оповещений	44
7.6 Определение статусов клиентов	46

Ваши пожелания и комментарии к данному Руководству

направляйте по электронной почте на адрес: quiksupport@arqatech.com



1. Общие сведения

CoLibri (далее «Модуль») является дополнительным модулем Рабочего места QUIK, предназначенным для решения комплекса задач, относящихся к маржинальному кредитованию клиентов брокера.

1.1 Возможности программы

Модуль позволяет:

- осуществлять мониторинг денежных и депо счетов, стоимости портфеля, некоторых вычисляемых параметров и заявок клиентов на сервере QUIK;
- автоматически генерировать и рассылать оповещения (Margin Call) при достижении стоимости портфеля клиента установленных ограничительных значений;
- переносить маржинальные позиции клиента сделками РЕПО и РПС различных типов;
- формировать и снимать заявки на закрытие позиций клиентов;
- рассчитывать потенциальные значения маржинальных показателей при изменении позиции клиентов.

1.2 Принципы работы с программой

1.2.1 Контроль маржинальных показателей

Модуль позволяет вести автоматический контроль за стоимостью портфеля по клиентам путем использования режима Margin Call. При включенном режиме производится периодическая проверка стоимости портфеля и ее сравнение с показателями начальной, минимальной и скорректированной маржи. В случае снижения стоимости портфеля ниже значения одного из перечисленных параметров происходит рассылка оповещений (Margin Call) в формате, заданном в настройках Модуля:

- Электронная почта.
- Сообщения трейдера.
- SMS-сообщения.
- Сообщения через MarginCall2Quik.

Для клиентов типа «МП», «МЛ» выполняется периодическое сравнение уровня маржи с заданными в Рабочем месте QUIK граничными уровнями.

Включение/отключение режима Margin Call осуществляется выбором пункта меню программы

Расширения / Colibri / Режим "Margin Call" или нажатием кнопки  на панели инструментов. Подробнее о режиме Margin Call см. п. [5.1](#).



1.2.2 Калькулятор для расчета планируемой позиции клиента

В случае недостаточности обеспечения клиента для покрытия обязательств по использованному маржинальному кредиту, Модуль помогает рассчитать потенциальные значения маржинальных показателей в случае ввода/вывода средств, а также объем средств, который необходимо довести или вывести. Для этих целей в программу встроен специальный калькулятор. Данная функция также может быть полезна для оценки изменения показателей кредитования в случае планируемого вывода средств клиентом. Подробное описание работы с калькулятором см. п. [4](#).

1.2.3 Перенос маржинальных позиций

Позиции клиентов, открытые с использованием маржинальных средств брокера и не закрытые самостоятельно до конца торговой сессии, могут быть реформированы (перенесены на следующий день) путем заключения сделок РЕПО или РПС. Функция переноса позиций может быть применена как к выбранному клиенту, так и ко всем клиентам. При запуске функции будет сформирован пакет сделок РЕПО или РПС, которые отображаются в специальной таблице «Заявки для переноса позиций». Далее пользователь Модуля может отправить заявки в торговую систему по критерию: «все непосланные», «все по клиенту». Подробнее о переносе позиций см. п. [5.2](#), о работе со сделками РЕПО или РПС в системе QUIK см. Руководство пользователя системы QUIK, раздел 7 «Операции брокера».

1.2.4 Заккрытие позиций

Функция предназначена для приведения позиций клиента в соответствие с требованиями, установленными регулятором. Заккрытие позиций осуществляется по инструментам валютного и фондового рынков. Подробнее о закрытии позиций см. п. [5.3](#).

1.3 Основные окна и пункты меню программы

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

- «[Заявки переноса позиций...](#)» – открыть таблицу заявок на перенос позиций;
- «[Изменение статусов клиентов...](#)» – открыть таблицу изменения статусов клиентов;
- «[Калькулятор](#)» – открыть маржинальный калькулятор для решения прямой и обратной задачи по изменению маржинальных показателей при изменении позиций клиента;
- «[Режим Margin Call](#)» – открыть форму настройки параметров режима Margin Call;
- «[Перенос позиций...](#)» – открыть форму переноса позиций клиентов;
- «[Заккрытие позиций...](#)» – открыть форму закрытия позиций клиентов;
- «[Настройки...](#)» – открыть окно редактирования настроек программы.

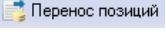
Также появляются дополнительные функции контекстного меню в таблице «Клиентский портфель»:

- «Включить / Выключить рассылку маржин-коллов для <код клиента>» – включение или выключение разрешения на рассылку оповещений по выбранному клиенту. Пункт доступен только при включенном [режиме рассылки оповещений](#);
- «Отправить маржин-колл для <код клиента>» – принудительная отправка клиенту уведомления настроенного типа, в соответствии с текущим состоянием выбранного клиента. Если настроено более одного типа уведомлений (см. п. [6.1.1](#)), то появляется локальное меню для выбора типа отправляемого маржин-колла:
 - «По стоимости портфеля» – применимо только к клиентам типа «МД». Пункт меню активен, если настроена рассылка хотя бы по одному из [уровней](#): ограничения, требования или закрытия;
 - «По недопустимой отрицательной позиции» – применимо только к клиентам типа «МД»;
 - «По уровню маржи» – применимо ко всем клиентам, кроме типа «МД», Уведомление считается включенным, если включена рассылка хотя бы по одному из уровней маржи;
 - «По доле использования глобального лимита» – применимо только к глобальным лимитам.
- «Отправить маржин-колл всем» – принудительная отправка всем клиентам, которые присутствуют в таблице «Клиентский портфель» и удовлетворяют условию уведомления настроенного типа. Если настроено более одного типа уведомлений (см. п. [6.1.1](#)), то появляется локальное меню для выбора типа отправляемого маржин-колла:
 - «По стоимости портфеля» – применимо только к клиентам типа «МД». Пункт меню активен, если настроена рассылка хотя бы по одному из [уровней](#): ограничения, требования или закрытия;
 - «По недопустимой отрицательной позиции» – применимо только к клиентам типа «МД»;
 - «По уровню маржи» – применимо ко всем клиентам, кроме типа «МД», Уведомление считается включенным, если включена рассылка хотя бы по одному из уровней маржи;
 - «По доле использования глобального лимита» – применимо только к глобальным лимитам.
- «Перенести позиции по <код клиента>» – открытие диалога [переноса](#) позиций для выбранного кода клиента;
- «Закрыть позиции по <код клиента>» – открытие диалога [закрытия](#) позиций для выбранного клиента.

1.3.1 Панель инструментов

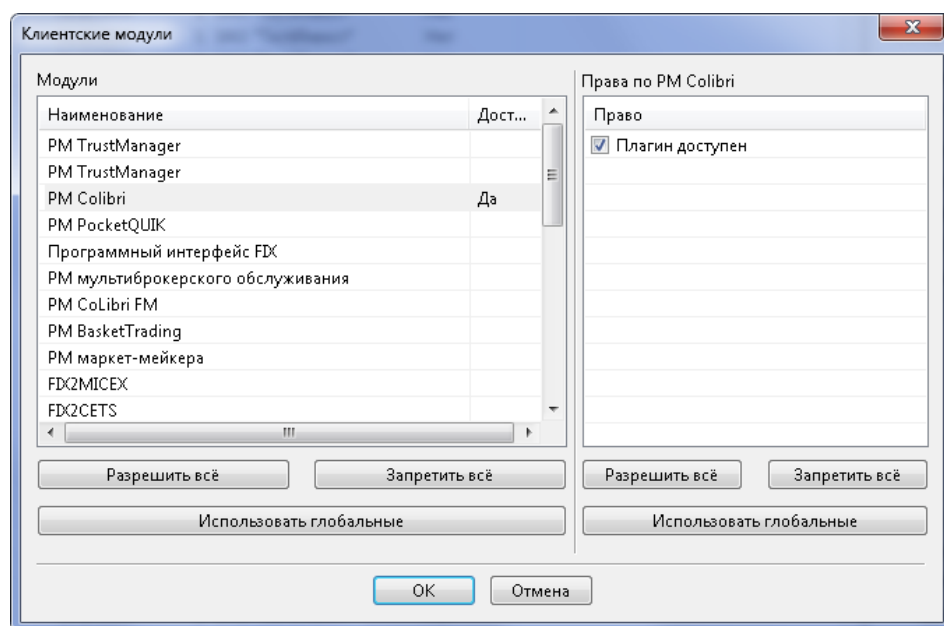
При наличии необходимых файлов и прав на работу с данным модулем, появляется дополнительная панель инструментов «Colibri», содержащая кнопки:



Кнопка	Действие
 Margin Call	Включить/выключить режим рассылки оповещений (Margin Call)
 Калькулятор	Открыть маржинальный калькулятор для расчета планируемой позиции клиента
 Закрывтие позиций	Открыть форму закрытия позиций клиентов
 Перенос позиций	Открыть форму переноса позиций клиентов

1.4 Подготовка к работе

1. Поместите файлы **Colibri.dll**, **qmail.dll** и **ps.dll** в папку Рабочего места QUIK. Перед копированием файлов в папку необходимо закрыть Рабочее место QUIK.
2. Включите в программе **QUIK Administrator** право на работу с Модулем. Право может быть установлено как глобально (пункт меню **Сервер QUIK / Клиентские модули**), так и индивидуально – через окно редактирования настроек пользователя (на вкладке «Общие права» необходимо нажать на кнопку «Изменить...» и в открывшемся окне установить права по модулю PM Colibri):



3. При использовании закрытия валютных позиций (см. п. [6.3.2](#)) необходимо в настройках Библиотеки расчета лимитов прописать классы, в которых торгуются валютные пары (см. настройку «Вести денежные позиции в разрезе валют» в п. 6 Руководства по настройке Библиотеки расчета лимитов).
4. Перезапустите Рабочее место QUIK для применения настроек.
5. Для того, чтобы сохранять журнал отправки оповещений в базе данных необходимо создать ODBC-источник следующим образом:

- В меню Рабочего места QUIK выберите пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки...**;
- В открывшемся окне выберите вкладки Colibri / Параметры рассылки оповещений / Журнал отправки оповещений;
- Включите флажок «Вести журнал отправки оповещений в БД», нажмите на кнопку «...» и в открывшемся диалоге нажмите на кнопку «ODBC Admin». На экране появится окно «Администратор источников данных ODBC», в котором нужно добавить созданную при помощи SQL-скрипта базу данных в качестве нового источника ODBC.

SQL-скрипт, создающий таблицу нужной структуры для сервера баз данных типа MS SQL, находится в комплекте поставки.

- Нажмите кнопку «Добавить», выберите драйвер «SQL Server». Нажмите кнопку «Готово»;
- Укажите имя источника данных «Colibri». Нажмите кнопку «OK» для сохранения настроек. В списке источников данных появится запись «Colibri». Нажмите кнопку «OK»;
- В окне «Выбор ODBC источника» выберите «Colibri» и нажмите кнопку «Да». Закройте окно настроек нажатием кнопки «OK».

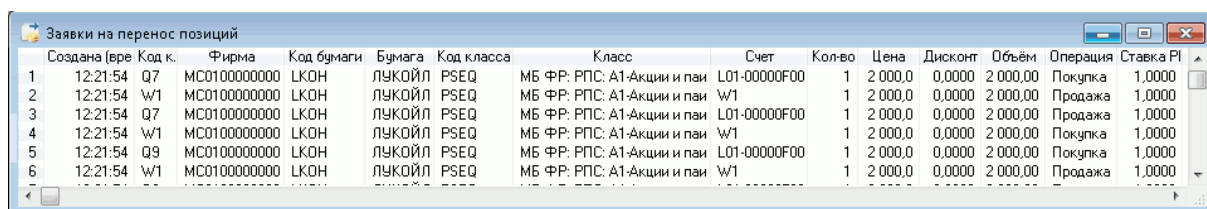
2. Таблица «Заявки на перенос позиций»

меню **Расширения / Colibri / Заявки переноса позиций...**

2.1.1 Назначение

Просмотр и редактирование списка сформированных адресных заявок РЕПО (РПС) на перенос коротких и длинных позиций клиентов. Выбор заявок для отправки в торговую систему и просмотр состояния их исполнения.

2.1.2 Формат таблицы



	Создана (вре)	Код к.	Фирма	Код бумаги	Бумага	Код класса	Класс	Счет	Колво	Цена	Дисконт	Объем	Операция	Ставка РИ
1	12:21:54	Q7	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	Л01-00000F00	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Покупка	1,0000
2	12:21:54	W1	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	W1	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Продажа	1,0000
3	12:21:54	Q7	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	Л01-00000F00	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Продажа	1,0000
4	12:21:54	W1	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	W1	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Покупка	1,0000
5	12:21:54	Q9	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	Л01-00000F00	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Покупка	1,0000
6	12:21:54	W1	МС0100000000	ЛКОН	ЛУКОЙЛ	PSEQ	МБ ФР: РПС: А1-Акции и паи	W1	1	2 000,0	0,0000	2 000,00	Продажа	1,0000

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

Название	Назначение
Создана (время)	
Код клиента	Идентификатор клиента в системе QUIK. Для заявок донора указывается код донора
Фирма	Код фирмы
Код бумаги	Код инструмента в торговой системе
Бумага	Наименование инструмента
Код класса	Код класса, к которому принадлежит данный инструмент
Класс	Наименование класса
Счет	Счет депо, в отношении средств которого заключается сделка
Кол-во	Количество бумаг в заявке, в лотах
Цена	Цена за единицу инструмента
Дисконт, %	Величина дисконта. Параметр заявок РЕПО с ЦК и РЕПО-М при использовании начального дисконта
Объем	Объем заявки. Параметр заявок РЕПО-М при использовании цены
Операция	Направленность заявки. Возможные значения: _ «В» – покупка; _ «S» – продажа
Ставка РЕПО(%) / Ставка (%)	Ставка кредитования РЕПО, в % годовых
Ставка возмещения(%)	Ставка возмещения в случае неисполнения второй части РЕПО, в % годовых
Код расчетов	Код расчетов по сделке
Срок РЕПО	Срок РЕПО, дней
Код донора	Код клиента, являющегося донором ценных бумаг. Для заявок донора указывается код исходного клиента
Партнер	Наименование участника торгов, которому адресована заявка
Орг-я партнера	
Номер	Номер заявки в торговой системе
Статус	Статус заявки. Возможные значения: _ <пусто> – заявка сформирована, но не отправлена в торговую систему; _ «Отправлена» – заявка отправлена на сервер QUIK, но ответ о регистрации в торговой системе еще не получен; _ «Отвергнута» – заявка отвергнута сервером QUIK; _ «Активна» – заявка зарегистрирована в торговой системе, но не



Название	Назначение
	удовлетворена встречной заявкой; – «Снята» – заявка отозвана из торговой системы; – «Исполнена» – заявка удовлетворена
Идентификатор	Уникальный идентификатор заявки, используемый для её идентификации в период, когда заявка ещё не отправлена в торговую систему и ей не присвоен номер
Комиссия	Сумма комиссий торговой системы, брокера и дополнительной комиссии на перенос позиций по сделкам РПС / РЕПО (см. п. 6.2.1)

2.1.3 Настройка таблицы

Настройка заключается в изменении названия таблицы, выборе перечня столбцов для просмотра в таблице и последовательности их отображения.

2.1.4 Доступные операции

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

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Приложении к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой» Руководства пользователя QUIK.

Операции, выполняемые из контекстного меню:

- «Отправить из таблицы» – отправить в торговую систему все заявки из таблицы;
- «Отправить по клиенту» – отправить в торговую систему все заявки с таким же кодом клиента, как в выбранной заявке;
- «Очистить все непосланные» – удалить все неотправленные заявки из таблицы;
- «Очистить все посланные» – удалить все отправленные заявки из таблицы;
- «Очистить все» – удалить все заявки;
- «Удалить» – удалить выбранную заявку;
- «Экспорт в файл» – вывести заявки из таблицы в текстовый файл (см. п. [2.1.5](#));
- «Переместить на закладку» – перемещение таблицы на другую закладку.

2.1.5 Формат вывода данных в текстовый файл

Функция сохранения данных в текстовый файл вызывается из контекстного меню таблицы. Файл представляет собой последовательность строк, каждая из которых содержит параметры отдельной заявки, разделенные запятыми («,») без пробелов.

Параметр	Примечание
Код класса	
Код инструмента	
Торговый счет	
Направление	«В» – купля, «S» – продажа
Код фирмы партнера	Для заявок от имени донора – код донора
Код клиента	Код клиента
Примечание	
Количество	
Тип заявки	Возможные значения: – «М» – РЕПО-М; – «R» – РЕПО; – «ССР» – РЕПО с ЦК; – «RPS» – РПС; – «RPS_CCP» – РПС с ЦК
Цена	Для заявок типа РЕПО-М и РЕПО с ЦК поле не заполняется
Код расчетов	
Возмещение (%)	Для заявок типа РЕПО с ЦК, РПС, РПС с ЦК поле не заполняется
Ставка РЕПО	Для заявок типа РПС, РПС с ЦК поле не заполняется
Сумма РЕПО	Для заявок типа РЕПО, РЕПО с ЦК, РПС, РПС с ЦК поле не заполняется
Срок РЕПО	Для заявок типа РЕПО, РПС, РПС с ЦК поле не заполняется
Начальный дисконт *	Для заявок типа РЕПО, РПС, РПС с ЦК поле не заполняется
Код донора	Для заявок донора – код исходного клиента
Торговый счет донора	
Статус отправки	«0» – не отправлено, «1» – отправлено
Статус приема	«0» – не принято, «1» – принято
Статус	Состояние заявки, представляющее собой число в десятичном виде. Двоичное представление числа отображает значения параметров заявки (Номер бита справа налево: значение TRUE; значение FALSE): – 0: TRUE – активна; FALSE – снята или исполнена; – 1: TRUE – снята; FALSE – исполнена; – 2: TRUE – заявка на покупку; FALSE – заявка на продажу; – 3: TRUE – лимитированная заявка; FALSE – рыночная; – 4: TRUE – разрешить исполнение заявки по разным ценам, FALSE – нет;

Параметр	Примечание
	5: TRUE – признак «исполнить немедленно или отклонить», FALSE – нет; 6: не используется; 7: не используется; 8: не используется; 9: не используется; 10: TRUE – признак «снять остаток», FALSE – нет. Например, число 25 означает активную лимитированную заявку на покупку с признаком «разрешить исполнение по разным ценам», или в двоичном виде – 11001

* – для заявок типа «РЕПО с ЦК» поле заполняется значением «Дисконт».

Пример строки файла:

```
RPMA,MSNG,L01-00000F00,B,MC0075600000,E5,E5//tech1,1900,M,,Rb,1,9,10204.9,6,,E3,L01-00000F00,0,0,0
```

3. Изменения статусов клиентов

меню **Расширения / Colibri / Изменение статусов клиентов...**

3.1.1 Назначение

Просмотр истории изменения статусов клиентов.

3.1.2 Формат таблицы

Изменения статусов клиентов								
	Дата	Время	Код клиента	Фирма	Статус до изме	УДС до изме	Новый статус	Новый УДС
1	08.07.2014	14:17:03	Q6	NC0038900000	Нормальный	9,99	Закрытие	-2,41
2	08.07.2014	14:17:13	Q6	NC0038900000	Закрытие	-2,41	Нормальный	9,99

Каждая строка таблицы соответствует изменению значения статуса клиента. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Название	Назначение
Идентификатор	Уникальный идентификатор записи
Дата	Дата изменения статуса клиента
Время	Время изменения статуса клиента

Название	Назначение
Код клиента	Идентификатор клиента в системе QUIK
Фирма	Код фирмы
Тип	Тип клиента: – «Д» – для схемы с дисконтами (клиенты типа «МД»); – «М» – для схемы с уровнями маржи (клиенты отличные от типа «МД»)
Статус до изменения	Для клиентов типа «МД» – состояние стоимости портфеля относительно уровня маржи до изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по последнему виду лимита. Для клиентов отличных от типа «МД» – текущий уровень маржи относительно заданного уровня до изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по лимиту вида Т0. Подробнее см. п. 7.6
Новый статус	Для клиентов типа «МД» – состояние стоимости портфеля относительно уровня маржи после изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по последнему виду лимита. Для клиентов отличных от типа «МД» – текущий уровень маржи относительно заданного уровня после изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по лимиту вида Т0. Подробнее см. п. 7.6
УДС до изменения	Уровень достаточности средств до изменения статуса клиента. Возможные значения: от «-9.99» до «9.99» с точностью 2 знака после запятой. Поле заполняется только для клиентов типа «МД»
УМ до изменения	Уровень маржи на виде лимита Т0 до изменения статуса клиента. Только для схемы с уровнями маржи. Отображается в процентах. Поле заполняется для клиентов отличных от типа «МД»
Новый УДС	Уровень достаточности средств после изменения статуса клиента. Возможные значения: от «-9.99» до «9.99» с точностью 2 знака после запятой. Поле заполняется только для клиентов типа «МД»
Новый УМ	Уровень маржи на виде лимита Т0 после изменения статуса клиента. Только для схемы с уровнями маржи. Отображается в процентах. Поле заполняется для клиентов отличных от типа «МД»

История изменения статусов ведется только для клиентов, присутствующих в списке допустимых клиентов, сформированном на основании фильтрации по коду клиента в таблице «Клиентский портфель». Если в Рабочем месте открыто несколько таблиц «Клиентский портфель», формируется единый список допустимых клиентов по всем таким таблицам. В случае, если клиент был исключен из списка допустимых клиентов, история изменения его статусов будет отображаться в таблице «Изменения статусов клиентов» до тех пор, пока она не будет очищена.

Строки в таблице выделяются цветом в зависимости от статуса клиента. Подробнее о цветовых настройках см. Руководство пользователя системы QUIK, Раздел 5 «Торговые операции клиента» (настройка «**Выделять цветом статус маржинальных клиентов**»).

Данные в таблице очищаются автоматически при смене сессии.

3.1.3 Настройка таблицы

Настройка заключается в изменении названия таблицы, выборе перечня столбцов для просмотра в таблице и последовательности их отображения.

3.1.4 Доступные операции

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

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Приложении к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой» Руководства пользователя QUIK.

Операции, выполняемые из контекстного меню:

- «Очистить» – очистить историю изменения статусов клиентов;
- «Переместить на закладку» – перемещение таблицы на другую закладку.

4. Калькулятор

меню **Расширения / Colibri / Калькулятор** или кнопка  Калькулятор

4.1.1 Назначение

Маржинальный калькулятор используется для:

- Расчета потенциальных значений маржинальных показателей в случае ввода/вывода актива;
- Расчета количества актива, которое необходимо ввести/вывести для достижения заданных маржинальных показателей.

4.1.2 Принцип работы

1. Расчет на основании величины «Изменение позиции»:

Расчет плановых маржинальных показателей производится на основании указанной пользователем величины желаемого изменения позиции (поле «Изменение позиции»).

2. Расчет на основании величины «Свободно (План)»:

Расчет количества указанного актива, которое необходимо довести / вывести, производится на основании указанной пользователем желаемой величины показателя «Свободно (План)».

4.1.3 Применение

В открытом окне поля имеют следующие назначения:

- «Код клиента» – ввод вручную или выбор кода клиента из выпадающего списка.
- «Бумага» – выбор ценной бумаги из выпадающего списка. Если флажок «Показать все инструменты» выключен, то список содержит только те активы, которые имеются в лимитах выбранного клиента (а также значение «Денежная позиция», если в качестве «Способа изменения» выбран «Ввод / Вывод»). Значение по умолчанию: «Денежная позиция» (для «Ввода / Вывода») или первый из активов в списке (для «Купли / Продажи»).
- «Показать все инструменты» – отображать все инструменты в списке «Бумага». По умолчанию флажок выключен.
- «Позиция» – позиция по последнему из видов лимита по выбранному клиенту и инструменту. Если у данного клиента есть несколько позиций по активу (несколько лимитов по разным торговым счетам для бумаг или по группам для денег), то отображается сумма позиций по этим лимитам.
- «Изменение позиции» – величина изменения выбранного актива (в зависимости от ввода / вывода средств). Используется для пересчета плановых маржинальных показателей (в том числе значения показателя «Свободно (План)»).
- «Способ изменения»:
 - «Ввод / Вывод» – операция по вводу / выводу активов. Переключатель выбран по умолчанию;
 - «Купля / Продажа» – операция по купле / продаже активов. При выборе данного режима в списке «Бумага» недоступен выбор значения «Денежная позиция».

Последний выбранный режим сохраняется в настройках.

- «Стоимость портфеля (Факт)» – оценка собственных средств клиента по текущим позициям и ценам, в денежном выражении.

- «Стоимость портфеля (План)» – плановая оценка средств клиента в денежном выражении.
- «Начальная маржа (Факт)» – фактическая величина начальной маржи.
- «Начальная маржа (План)» – плановая величина начальной маржи.
- «Минимальная маржа (Факт)» – фактическая величина минимальной маржи.
- «Минимальная маржа (План)» – плановая величина минимальной маржи.
- «Свободно (Факт)» – фактическая величина свободных активов клиента. Рассчитывается как разница показателей «Стоимость портфеля» и «Начальная маржа».
- «Свободно (План)» – требуемая величина свободных активов клиента. Рассчитывается как разница показателей «Стоимость портфеля (План)» и «Начальная маржа (План)».

Для расчета плановых значений показателей в результате изменения позиции, необходимо выбрать код клиента, бумагу, указать величину изменения позиции и нажать кнопку «Пересчитать».

Для расчета плановой величины доведения/вывода указанного актива, необходимо выбрать код клиента, бумагу, указать желаемую величину показателя «Свободно (план)» и нажать кнопку «Пересчитать».

Если требуется обновить текущие значения маржинальных показателей в калькуляторе (не меняя выбранный код клиента) необходимо нажать кнопку «Пересчитать».

Если в результате расчета показатели «Стоимость портфеля (Факт)», «Стоимость портфеля (План)», «Начальная маржа (Факт)», «Начальная маржа (План)», «Минимальная маржа (Факт)», «Минимальная маржа (План)», «Свободно (Факт)» принимают значения, превосходящие по модулю величину 1025, то вместо числового значения в данных полях отображается значение «INF».

5. Основные функции программы

5.1 Режим Margin Call

меню Расширения / Colibri / Режим «Margin Call» или кнопка 

5.1.1 Назначение

Автоматическая рассылка оповещений клиентам и администраторам в виде сообщений заданного содержания (на адреса электронной почты, на терминалы QUIK либо на телефон через SMS).

Для клиентов типа «МД» рассылаются оповещения при достижении параметром «Стоимость портфеля» определенных значений, а также о наличии короткой позиции по немаржинальному инструменту. Для клиентов отличных от типа «МД» рассылаются оповещения при достижении

уровнем маржи различных граничных значений. Возможна рассылка уведомлений по доле использования глобального лимита.

5.1.2 Принцип работы режима Margin call

Модуль автоматически создает и рассылает сообщения следующих типов:

- Ограничение на торговые операции – стоимость портфеля меньше величины скорректированной маржи.
- Предупреждение о малой стоимости портфеля – стоимость портфеля меньше величины начальной маржи.
- Принудительное закрытие позиций – стоимость портфеля меньше величины минимальной маржи.
- Наличие отрицательной позиции по немаржинальным инструментам и инструментам типа «Д».
- Сообщения, созданные при переходе величины уровня маржи через настроенные [уровни](#) ограничения, требования или закрытия.
- Превышение доли использования глобального лимита.

Рассылка оповещений возможна следующими способами:

- Электронная почта.
- Сообщения трейдера.
- SMS-сообщения.
- Сообщения через MarginCall2Quik.

При рассылке оповещений используются настройки, позволяющие предотвратить слишком частую рассылку. Заданные настройки могут применяться одновременно и независимо. Для различных типов клиентов и типов оповещений имеются отличия:

- Для МД-клиентов:
 - Оповещения по сравнению стоимости портфеля и значения различных типов маржи. Применимо задание минимального времени между двумя оповещениями, минимального изменения отслеживаемого параметра, минимальная величина изменения УДС (см. п. [6.1](#));
 - Оповещения по наличию недопустимой отрицательной позиции. Отправляется один раз, по возникновению недопустимой позиции. Повторная отправка возможна только при появлении у клиента недопустимой позиции ещё по одному активу.
- Для МП-клиентов:
 - Оповещения по величине уровня маржи. Применимо задание минимального времени между двумя оповещениями, минимального изменения отслеживаемого параметра (см. п. [6.1](#)).

- Для глобальных лимитов применимы следующие оповещения:
 - Оповещение по доле используемого глобального лимита. Применимо задание минимального времени между двумя оповещениями, минимального изменения отслеживаемого параметра (см. п. [6.1](#)).

Оповещения можно отправлять как [одному выбранному клиенту](#), так и по [всем клиентам](#).

Оповещения отправляются только клиентам, присутствующим в списке допустимых клиентов, сформированном на основании фильтрации по коду клиента в таблице «Клиентский портфель». Если в Рабочем месте открыто несколько таблиц «Клиентский портфель», формируется единый список допустимых клиентов по всем таким таблицам.

Текст отправляемого оповещения, создаётся на основе шаблонов, при этом определяется какой тип шаблонов (см. п. [5.1.5](#)) должен использоваться. Для оповещений типа «По недопустимой отрицательной позиции» и «По доле использования глобального лимита» шаблон всегда один. Для оповещений «По величине маржи» и «По уровню маржи» для каждого клиента проверяется условие на сравнение стоимости портфеля с различными типами маржи (для клиентов типа «МД» тип «По величине маржи») или на сравнение уровня маржи с различными граничными значениями (для клиентов типа «МП», «МЛ» тип «По уровню маржи»).

5.1.3 Механизм генерации маржин-коллов

Для клиентов типа «МД» маржин-коллы генерируются при переходе величины стоимости портфеля через настроенные [уровни](#) ограничения, требования или закрытия (см. п. [6.1.1](#) Схема с дисконтами).

Для клиентов, отличных от типа «МД», маржин-коллы генерируются при переходе величины уровня маржи через настроенные [уровни](#) ограничения, требования или закрытия (см. п. [6.1.1](#) Другие схемы).

5.1.4 Управление режимом

Для активации возможности включения режима Margin call выполните следующие действия:

1. Выберите шаблон уведомления для одного или нескольких условий (раздел **Colibri / Параметры рассылки оповещений** в настройках клиентского места). Подробнее см. п. [6.1](#).
2. Выберите способ рассылки оповещений (разделы **Colibri / Параметры рассылки оповещений / Рассылка по e-mail** и **Colibri / Параметры рассылки оповещений / Рассылка на UID** в настройках клиентского места). Подробнее см. пп. [6.1.2](#) и [6.1.3](#).

Режим активируется только при наличии связи с сервером QUIK и после получения всех необходимых для работы данных.

Управление режимом Margin call осуществляется следующими способами:

- Выбором пункта меню программы **Расширения / Colibri / Режим "Margin Call"**;

- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Выбором пункта контекстного меню «Включить / Выключить рассылку маржин-коллов для <код клиента>» в таблице «Клиентский портфель».

Если режим Margin Call включен, то кнопка на панели инструментов имеет нажатое состояние.

При выключении режима рассылки в рамках сессии отслеживание маржинальных показателей клиентов прекращается, но информация об отправленных ранее оповещениях сохраняется.

При повторном включении режима в рамках сессии отправка новых оповещений производится с учетом ранее отправленных уведомлений. После разрыва соединения оповещения рассылаются повторно, независимо от того, были ли они отправлены ранее.

Параметры рассылки оповещений задаются в окне настроек. Подробнее настройки параметров рассылки оповещений описаны в п. [6.1](#).

5.1.5 Формат файла оповещения

Файл представляет собой документ с текстом сообщения, отправляемый клиенту по электронной почте. В шаблоне документа могут быть указаны следующие параметры, которые при рассылке Модуль заменяет конкретными показателями.

Формат файла оповещения для клиентов типа «МД»:

Параметр	Значение
%cc	Код клиента
* %lk	Вид лимита
%val	Стоимость портфеля
%sm	Размер начальной маржи
%mm	Размер минимальной маржи
%cm	Размер скорректированной маржи
* %nmsc	Код немаржинального инструмента, по которому обнаружена короткая позиция
* %nmta	Торговый счет
* %nmsn	Наименование немаржинального инструмента, по которому обнаружена короткая позиция
%im1	Сумма денежных средств, которую необходимо довести для того, чтобы стоимость портфеля была не меньше размера начальной маржи
%ct	Время создания оповещения в формате <ЧЧ:ММ:СС>
%cd	Дата создания оповещения в формате <ДД.ММ.ГГГГ>

Параметр	Значение
%em	Список (через запятую) электронных адресов, который используется для этого клиента
%UIDs	Список (через запятую) UserID, которые используются для этого клиента

* – параметры уведомления о наличии короткой позиции по немаржинальной бумаге.

Формат файла оповещения по уровню маржи для всех типов клиентов, кроме «МД»:

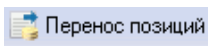
Параметр	Значение
%cc	Код клиента
%lk	Вид лимита
%m	Текущий уровень маржи
%vd	Средства в ценных бумагах
%vm	Текущий остаток по деньгам
%eq	Стоимость портфеля
%M1	Значение уровня маржи принудительного закрытия для данного клиента
%M2	Значение уровня маржи для направления требования для данного клиента
%M3, %cm	Значение ограничительного уровня маржи для данного клиента
%ct	Время создания оповещения в формате <ЧЧ:ММ:СС>
%cd	Дата создания оповещения в формате <ДД.ММ.ГГГГ>
%em	Список (через запятую) электронных адресов, который используется для этого клиента
%UIDs	Список (через запятую) UserID, которые используются для этого клиента

Формат файла оповещения по доле использования глобального лимита:

Параметр	Значение
%lk	Вид лимита
%val	Текущий размер неиспользованной доли глобального лимита

Параметр	Значение
%glsc	Код инструмента (для глобального лимита по инструменту) или код валюты (для глобального лимита по деньгам)
%glsn	Наименование инструмента (для глобального лимита по инструменту) или код валюты (для глобального лимита по деньгам)
%glta	Торговый счет (для глобального лимита по инструменту) или группа (для глобального лимита по деньгам)
%ct	Время создания оповещения в формате <ЧЧ:ММ:СС>
%cd	Дата создания оповещения в формате <ДД.ММ.ГГГГ>
%em	Список (через запятую) электронных адресов, который используется для этого клиента
%UIDs	Список (через запятую) UserID, которые используются для этого клиента

5.2 Перенос позиций

меню **Расширения / Colibri / Перенос позиций...** или кнопка 

5.2.1 Назначение

Подготовка адресных заявок типа РЕПО или РПС для сделок по переносу позиций клиентов, использующих маржинальные средства брокера. В дальнейшем под «сделками» понимаются сделки РЕПО или РПС в зависимости от выбранного типа.

5.2.2 Принцип работы

Короткие позиции клиентов, незакрытые самостоятельно до конца торговой сессии, могут быть реформированы брокером при помощи адресных сделок. Одной стороной сделки является имеющий задолженность клиент, второй стороной – клиент-донор, кредитующий его ценными бумагами или деньгами.

При переносе коротких позиций производится перенос всех отрицательных позиций клиента по бумагам. В результате выполнения данного действия создается пакет встречных заявок РЕПО (РПС), который передается на исполнение в торговую систему биржи. После исполнения второй части сделки, бумаги со счета клиента возвращаются клиенту-донору. Тем самым, осуществляется перенос короткой позиции на указанный срок.

Аналогичным образом устроен перенос длинных позиций клиентов. Отличие от переноса коротких позиций состоит в необходимости выбора бумаг, позиции по которым будут перенесены. При формировании заявок РЕПО (РПС) Модуль анализирует все позиции клиентов, имеющих отрицательный остаток по денежным средствам при положительном остатке

по бумагам, и генерирует по ним заявки в таком объеме, чтобы привести остаток денежных средств к положительному значению.

Количество бумаг в заявках формируется с учетом кратности лота, установленной для данного инструмента. При переносе коротких позиций рассчитанное количество бумаг округляется вверх до ближайшего целого, кратного значению «Кратности лота». При переносе длинных позиций для каждого инструмента с положительным остатком учитывается не весь положительный остаток, а только остаток, округлённый вниз до ближайшего целого, кратного параметру «Кратность лота».

Исполнение второй части РЕПО (РПС) может осуществляться как через рабочее место участника биржевых торгов, так и при помощи системы QUIK. Подробнее об операциях РЕПО и РПС см. Глава 7. «Операции брокера», п. 7.20, п. 7.21 Руководства пользователя системы QUIK.

- 1. При переносе позиций по классам РПС и РПС с ЦК и для клиента, и для клиента-донора по каждой позиции формируются две адресные заявки со встречным направлением и с использованием различных кодов расчетов (например, «B0» для первой части и «B1» для второй части). При переносе позиций по классам РЕПО, РЕПО-М и РЕПО с ЦК и для клиента, и для клиента-донора формируется только одна адресная заявка РЕПО.**
- 2. Если заявка клиента не была отправлена в торговую систему (или же был получен отказ в ее получении), то встречная заявка от имени клиента-донора не подаётся. При этом статус встречной заявки остаётся пустым.**

5.2.3 Перенос коротких и длинных позиций

Открытие диалога переноса позиций осуществляется следующими способами:

- Выбором пункта меню программы **Расширения / Colibri / Перенос позиций...**;
- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Выбором пункта контекстного меню «Перенести позиции по <код клиента>» в таблице «Клиентский портфель».

Для переноса позиций необходимо задать список классов, по которым возможен перенос, а также приоритет использования бумаг в настройках Модуля (**Расширения / Colibri / настройки....**, раздел Colibri / Перенос позиций / Классы и бумаги). Подробнее см. в п. [6.2.1](#).

Для одновременного переноса коротких и длинных позиций должен быть установлен флажок «Разрешить одновременный перенос длинных и коротких позиций» в окне настроек переноса позиций.

Перенос позиций возможен с помощью сделок РЕПО и РПС. В случае переноса позиций с помощью сделок РЕПО пользователем указывается ставка РЕПО, а при переносе позиций с помощью РПС – указывается ставка, на основании которой рассчитывается цена для второй сделки РПС. Далее под термином «Ставка» понимается ставка для сделок РЕПО и РПС.

Алгоритм переноса всех позиций:

1. Формируются заявки на перенос коротких позиций. Учитываются все настройки, влияющие на коррекцию расчетов (например, учёт комиссии).

Для учёта комиссии при переносе позиций включите настройку «При расчете маржинальных показателей учитывать бумаги на РПС и РЕПО режимах» (пункт меню Система / Настройки / Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Клиентский портфель»).

2. Формируются заявки на перенос длинных позиций. Также учитываются все настройки, влияющие на коррекцию расчетов. В результате у клиента не должно быть отрицательных позиций ни по деньгам, ни по бумагам (с учётом комиссий). В случае, если для полного переноса позиций клиента бумаг недостаточно, позиции всё равно переносятся, но пользователь получает предупреждение о недостаточности средств.
3. Заявки на перенос позиций отправляются на сервер QUIK в следующем порядке: сначала все заявки клиента, затем – встречные заявки клиента-донора.

Если выбран перенос позиций для всех клиентов, то алгоритм по очереди применяется к каждому из клиентов, отображаемых в таблице параметров клиентов.

Если в Рабочем месте QUIK включена настройка «Запрашивать подтверждение для групповых операций» (пункт меню Система / Настройки / Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Заявки»), то при отправке более одной подготовленной заявки на исполнение выдается запрос на подтверждение операции.

5.2.4 Параметры переноса позиций

В окне «Перенос позиций» доступны следующие параметры:

1. «Позиции со сроком расчетов» – выберите из списка вид лимита, по которому нужно перенести позицию.
 - Для классов типа «РЕПО-М», «РПС», «РПС с ЦК», «РЕПО с ЦК» список содержит значения «Т0», «Т1»;
 - Для классов типа «РЕПО» список содержит только значение «Т0».
2. «Все клиенты» – если флажок установлен, то позиции переносятся по всем клиентам. Если флажок снят, то позиции переносятся по клиенту, выбранному в выпадающем списке, либо по клиентам, указанным в фильтре клиентов с помощью кнопки «...». Из списка, прежде всего, исключаются клиенты, отсутствующие в списке допустимых клиентов, сформированном на основании фильтрации по коду клиента в таблице «Клиентский портфель» (если открыто несколько таблиц «Клиентский портфель», формируется единый список по всем таким таблицам), а затем те, по которым перенос позиций запрещен в настройках.

3. Переключатель по типу переносимой позиции:

- «Длинные»;
- «Короткие»;
- «Все позиции» – доступно при установленном в настройках программы признаке «Разрешить одновременный перенос длинных и коротких позиций».

4. «Использовать классы» – выберите тип класса, используемый при переносе позиций (РЕПО, Мод. РЕПО, РЕПО с ЦК, РПС, РПС с ЦК).

5. «Указывать цену» – выберите способ определения цены заявки. Возможные значения:

- «Последней сделки» – установить цену заявки по цене последней сделки. Доступно для всех классов, кроме «РЕПО с ЦК»;
- «Закрытия предыдущего дня» – установить цену заявки по цене закрытия предыдущего дня. Доступно для всех классов, кроме «РЕПО с ЦК»;
- «Указывать вручную» – указать цену заявки вручную. Доступно для всех классов, кроме «РЕПО с ЦК»;
- «Через дисконт» – цена заявки задается значением начального дисконта. Доступно только для классов типа «РЕПО с ЦК»;
- «Через начальный дисконт» – цена заявки задается значением начального дисконта. Доступно только для классов типа «Мод. РЕПО».

6. «Клиенты-доноры» – укажите код клиента, предоставляющего ценные бумаги.

Можно указать несколько кодов клиентов-доноров (порядок важен), используя кнопку «...». В этом случае позиции переносятся с учетом наличия средств у указанных клиентов-доноров, то есть в процессе закрытия позиций сначала используются (до исчерпания) средства донора №1, затем донора №2 и так далее.

По умолчанию содержит значение, заданное в настройках для переноса позиций.

- 7.** «Торговые счета совпадают с кодами клиентов» – если флажок включен, то для каждого клиента-донора используется торговый счёт, совпадающий с кодом клиента. При этом поле «Торговый счет донора» становится недоступным. Признак доступен, если выбран хотя бы один код клиента-донора.
- 8.** «Торговый счет донора» – выберите из списка торговый счет клиента-донора. Поле обязательно для заполнения.
- 9.** «Клиенты для внутреннего закрытия» – если флажок установлен, то доступен выбор клиентов для внутреннего закрытия. Признак доступен, если выбран хотя бы один код клиента-донора и в настройках программы установлен флажок «Разрешить внутреннее закрытие позиций».
- 10.** «Срок РЕПО (дней)» / «Срок (дней)» – для классов типа «РЕПО» выберите срок исполнения второй части РЕПО, в днях / для классов типа «РПС», «РПС с ЦК» в поле указывается количество календарных дней между текущей датой и датой исполнения вторых сделок РПС (по возврату средств). Значение должно быть не более «90».
- 11.** «Код расчетов» – выберите из выпадающего списка код проведения расчетов по сделке. Возможные значения:

- Для классов типа «РПС»:
 - «Т0», «В0» – для позиций «Т0»;
 - «В01» – для позиций «Т1».
- Для классов типа «РПС с ЦК»:
 - «Y0» – для позиций «Т0»;
 - «Y1» – для позиций «Т1».
- Для классов типа «РЕПО»:
 - «R<срок РЕПО>».
- Для классов типа «РЕПО-М»:
 - «Rb» – для позиций «Т0»;
 - «S01» – для позиций «Т1».
- Для классов типа «РЕПО с ЦК»:
 - «Т0», «Y0» – для позиций «Т0»;
 - «Y1» – для позиций «Т1».

Если для данной позиции доступно только одно значение кода расчетов по сделке, то это значение отображается по умолчанию без возможности редактирования.

- 12.** «Ставка РЕПО, %» / «Ставка, %» – укажите значение ставки кредитования, в процентах. Если включен режим «Автовыбор знака ставки РЕПО», то ставка вводится в виде ее абсолютной величины, а необходимый знак («плюс» для переноса длинных позиций или «минус» для переноса коротких) выбирается автоматически при подаче заявок. Поле обязательно для заполнения.

Если размер Ставки изменен (по сравнению с предыдущим значением), и при этом существует непустой список клиентов, по которым задана индивидуальная ставка для переноса позиций, то выдается предупреждение: «Вы изменили ставку РЕПО по умолчанию. Применить ее ко всем клиентам?». При утвердительном ответе выбранный размер Ставки применяется ко всем клиентам, включая тех, для кого был установлен индивидуальный размер Ставки. Иначе выбранный размер Ставки применяется только к тем клиентам, у которых не установлен размер индивидуальной Ставки.

- 13.** «Начальный дисконт, %» / «Дисконт, %» – условие сделки РЕПО, указывается в заявке на заключение сделки РЕПО в явном виде или однозначно определяется из условий заявки. Доступно для классов типа «РЕПО-М», если в качестве способа определения цены выбран вариант «Через начальный дисконт», и для классов типа «РЕПО с ЦК».
- 14.** «Возмещение, %» – укажите ставку возмещения при невыполнении второй части РЕПО, в процентах. Доступно для классов типа «РЕПО», «РЕПО-М». Поле обязательно для заполнения.
- 15.** «Ссылка» – текст-связка для заявок РЕПО.
- 16.** «Партнер» – выберите код участника торгов, являющегося партнером по сделке РЕПО. Поле обязательно для заполнения.

Для создания заявок нажмите кнопку «Да». Чтобы закрыть окно без отправки заявок, нажмите «Отмена». Если было выбрано условие выбора цены заявки вручную, на экране появится окно для ввода значения цены.

При наличии в таблице «Заявки на закрытие коротких позиций» хотя бы одной заявки по выбранному коду клиента, программа запросит подтверждение на повторное создание заявок. При этом новые заявки будут добавлены в таблицу с сохранением предыдущих. Во избежание путаницы рекомендуется перед повторным созданием пакета заявок удалять все неотправленные заявки.

5.3 Заккрытие позиций

меню **Расширения / Colibri / Заккрытие позиций...** или кнопка  **Заккрытие позиций**

5.3.1 Назначение

Процедура закрытия позиций применяется при достижении клиентом условия, при котором требованиями брокера или регулятора необходимо закрыть позиции (или их часть) для достижения допустимого состояния.

Алгоритм закрытия зависит от типа клиента:

- Для клиентов типа «МД» используется закрытие позиций по дисконтам: за счёт закрытия части (или всех) клиентских позиций маржинальный статус клиента изменяется таким образом, чтобы стоимость его портфеля превышала значение начальной маржи на величину, размер которой определяется брокером.
- Для клиентов, отличных от типа «МД», используется закрытие позиций по уровню маржи: используется доведение текущего уровня маржи клиента до заданного брокером. Если текущий уровень маржи клиента больше или равен заданному уровню маржи, то закрытие позиций по данному клиенту не производится. Если в настройках Рабочего места QUIK (пункт меню **Система / Настройки / Основные настройки...**, раздел «Торговля» / «Клиентский портфель») установлен флажок «Учитывать признак квалифицированности», то при определении заданного уровня маржи Модулем учитывается тип клиента: обычный или квалифицированный.

5.3.2 Принцип работы

1. В настройках клиентского места (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки / Colibri / Заккрытие позиций**) назначаются правила, по которым будут создаваться заявки (см. п. [6.3](#)).
2. Создание заявок осуществляется в диалоге «Заккрытие позиций», который можно открыть следующими способами:

- Выбором пункта меню программы **Расширения / Colibri / Заккрытие позиций...**;
- Нажатием кнопки  **Заккрытие позиций** на панели инструментов;
- Выбором пункта контекстного меню «Заккрыть позиции по <код клиента>» в таблице «Клиентский портфель».

В открывшемся диалоге выбирается список клиентов, для которых требуется закрытие позиций. Правило закрытия позиций, настроенное по умолчанию, может быть изменено для текущей операции.

3. Для выбранных клиентов формируется список инструментов, позиции по которым требуется закрыть.

- При закрытии позиций по дисконтам:

Производится формирование заявок на закрытие отрицательных позиций по немаржинальным инструментам или инструментам типа «Д» для клиентов. Для клиентов, не имеющих отрицательных позиций по немаржинальным инструментам, производится формирование заявок на закрытие положительных и отрицательных позиций по всем маржинальным инструментам. Разрешение на закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам устанавливается включением признака «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» (см. п. [6.3.2](#)).

Для каждого инструмента определяется режим торгов, по которому будет производиться закрытие. Позиции по видам лимитов, отличным от вида лимита, соответствующего этому режиму торгов, игнорируются.

- При закрытии позиций по уровню маржи:

Производится формирование заявок на закрытие отрицательных и положительных позиций по бумагам типа «М» или «МО». Разрешение на закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам устанавливается включением признака «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» (см. п. [6.3.2](#)).

Для каждого инструмента определяется режим торгов, по которому будет производиться закрытие, и проверяется соответствующий этому режиму вид лимита. Позиции по видам лимитов, отличным от T0, игнорируются.

4. Сортировка списка инструментов производится в соответствии с одним из следующих алгоритмов:

- Пропорционально позиции – все позиции уменьшаются на одну и ту же долю в денежной оценке.
- Порядок инструментов – учитывается порядок инструментов в списке инструментов для закрытия позиций. Если обработки всех инструментов из списка недостаточно для достижения заданных маржинальных показателей, то обрабатываются инструменты, допустимые для закрытия, но не входящие в список инструментов, заданный в правиле закрытия.

5. Производится расчет заявок для закрытия позиций.

Количество инструментов в заявках формируется с учетом кратности лота, установленной для данного инструмента. Если размер позиции не кратен размеру лота, то возможно использование режима неполных лотов.

Цена заявки на закрытие позиции определяется следующим образом:

- при закрытии коротких позиций используется цена предложения;
- при закрытии длинных позиций используется цена спроса

Если цена предложения/спроса отсутствует, то используется цена последней сделки или цена закрытия (в порядке уменьшения приоритета).

До отправки в торговую систему заявки в списке доступны для редактирования и удаления.

6. При нажатии кнопки «Выполнить» заявки отправляются в торговую систему биржи.

Если в Рабочем месте QUIK включена настройка «Запрашивать подтверждение для групповых операций» (пункт меню **Система / Настройки / Основные настройки...**, раздел «Торговля» / «Заявки»), то при отправке более одной подготовленной заявки на исполнение выдается запрос на подтверждение операции.

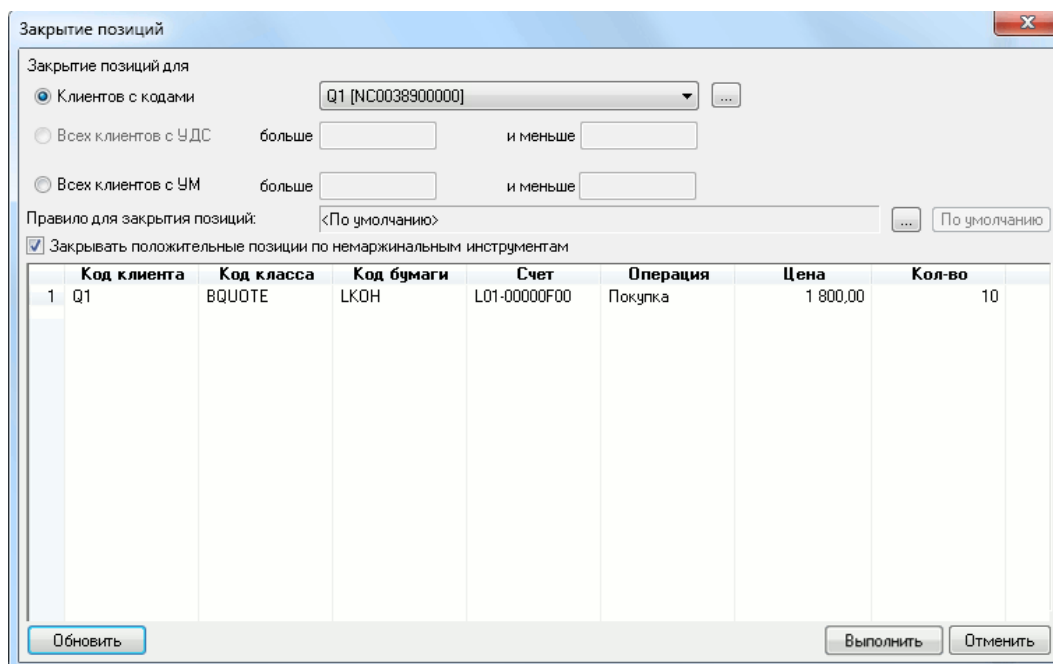
5.3.3 Параметры закрытия позиций

Окно закрытия позиций содержит следующие параметры:

1. «Закрытие позиций для»:

- «Клиентов с кодами» – выбор кодов клиентов для закрытия позиций, через запятую;
- «Всех клиентов с УДС больше ... и меньше ...» – выбор клиентов для закрытия позиций с учетом минимального и максимального уровня достаточности средств. Значения, указываемые в полях настройки, не могут быть больше единицы. В фильтр попадают только клиенты типа «МД». Поле активно, если в настройках (см. п. [6.3.2](#)) разрешено закрытие позиций по дисконтам;
- «Всех клиентов с УМ больше ... и меньше ...» – выбор клиентов для закрытия позиций с учетом минимального и максимального уровня маржи. Значения, указываемые в полях настройки, задаются в процентах и не могут быть больше ста. В фильтр попадают все типы клиентов, кроме «МД». Поле активно, если в настройках (см. п. [6.3.2](#)) разрешено закрытие позиций по уровню маржи.

Фильтрация осуществляется только по клиентам, отображаемым в таблице «Клиентский портфель» в соответствии с фильтром по коду клиента. Если в Рабочем месте открыто несколько таблиц «Клиентский портфель», формируется единый список допустимых клиентов по всем таким таблицам.



	Код клиента	Код класса	Код бумаги	Счет	Операция	Цена	Кол-во
1	Q1	BQUOTE	LCON	L01-00000F00	Покупка	1 800,00	10

2. «Правило для закрытия позиций» – изменение правила закрытия позиций, настроенного по умолчанию, для текущей операции закрытия.

По нажатию кнопки «...» открывается окно «Редактирование правила закрытия позиций», идентичное окну, вызываемому из настроек программы (см. п. [6.3.1](#)). Редактирование настроек не изменяет параметры закрытия, заданные в настройках программы.

Для возврата к настройкам по умолчанию нажмите кнопку «По умолчанию».

3. «Закрывать положительные позиции по немаржинальным инструментам» – при включенном признаке допустимо использование положительных позиций по немаржинальным инструментам в текущей операции закрытия. Редактирование настроек не изменяет параметры закрытия, заданные в настройках программы. По умолчанию флажок снят.

4. Таблица заявок на закрытие позиций содержит следующие поля:

- Код клиента;
- Код класса;
- Код бумаги;
- Счет;
- Операция;
- Цена;
- Кол-во;
- Комиссия.

Операции, выполняемые из контекстного меню таблицы:

- «Изменить» – изменить параметры заявки. Пункт меню доступен в колонках «Цена» и «Кол-во». В качестве «Цены» и «Кол-ва» может быть введено любое положительное число.

Для сохранения значений нажмите «Enter» или «Tab». Режим редактирования также включается двойным щелчком мыши на заявке.

- «Удалить» – удалить заявку из списка. Для того, чтобы обновить список заявок, нажмите «Обновить» (при этом изменения параметров заявок не сохраняются). Для отправки заявок на сервер QUIK для исполнения нажмите кнопку «Выполнить». Чтобы закрыть окно без отправки заявок, нажмите «Отменить».

6. Настройки программы

Диалог настроек Модуля открывается выбором пункта меню **Расширения / Colibri / Настройки...**
Параметры настроек Модуля доступны в разделе «Colibri» и сгруппированы по вкладкам.

6.1 Параметры рассылки оповещений

- «Включать рассылку автоматически» – включение рассылки оповещений. По умолчанию флажок установлен.
 - «При соединении с сервером QUIK» – включение рассылки оповещений при соединении с сервером QUIK. По умолчанию переключатель установлен;
 - «В период времени с ... по ...» – включение рассылки оповещений в заданный интервал времени.
- * «Минимальное время между двумя оповещениями ... секунд» – минимальное время в секундах между двумя последовательными оповещениями одного типа по одному клиенту. Значение по умолчанию: «» (пусто) (параметр не задан).
- * «Минимальное изменение отслеживаемого параметра ... единицы валюты / %» – минимальное значение изменения (ухудшения) стоимости портфеля между двумя последовательными оповещениями одного типа по одному клиенту в единицах валюты или процентах. По умолчанию выбран режим задания параметра в единицах валюты. Значение по умолчанию: «» (пусто) (параметр не задан).
- * «Минимальная величина изменения УДС» – минимальная величина изменения УДС между двумя последовательными оповещениями одного типа по клиентам типа МД. По умолчанию: «» (пусто) параметр не задан.
- * «Запретить отправку оповещений после временного улучшения параметров портфеля» – при включенном признаке отправка оповещения возможна только если текущее значение стоимости портфеля хуже, чем в момент отправки предыдущего оповещения. По умолчанию флажок снят.

(*) Данные настройки позволяют сократить частоту отправляемых оповещений.

- «Уведомлять об отправке оповещений» – режим уведомления об оповещениях:
 - «Системное сообщение» – в момент отправки каждого оповещения в таблицу «Системных сообщений» (Рабочего места QUIK) добавляется сообщение об отправке оповещения. Если оповещение отправляется несколькими способами одновременно и / или по нескольким адресам, то сообщение об отправке оповещения формируется однократно;

- «Звуковой сигнал» – назначение звукового сигнала отправляемым оповещениям. Для выбора звукового сигнала, нажмите кнопку «Из файла». Выбранный звуковой файл можно прослушать нажатием кнопки . Для выбора другого файла, нажмите кнопку «...».
- «Рассылка уведомлений отключена для» – отключение рассылки уведомлений по выбранному из выпадающего списка клиенту. Кнопка «...» вызывает диалог просмотра и изменения списка клиентов. Если выбрано несколько клиентов, то в выпадающем списке указывается общее число выбранных клиентов.
- «Очищать при начале новой торговой сессии» – режим очистки списка выбранных клиентов в момент начала новой торговой сессии сервера Quik. По умолчанию он выключен. При редактировании клиентских кодов с отключённой рассылкой появляется модальный диалог.

6.1.1 Типы уведомлений

Схема с дисконтами

Оповещения для клиентов типа «МД».

- «Уведомлять об уровнях» – включение рассылки оповещений при достижении следующих условий:
 - «Ограничение (меньше скорректированной маржи)» – стоимость портфеля меньше скорректированной маржи и больше либо равна начальной марже;
 - «Требование (меньше Начальной маржи)» – стоимость портфеля меньше начальной маржи и больше либо равна минимальной марже;
 - «Закрытие (меньше Минимальной маржи)» – стоимость портфеля меньше минимальной маржи.
- «Шаблоны уведомлений» – выбор файла для загрузки шаблона оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «...». Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.5](#).
- «Уведомлять о ситуациях» – включение рассылки оповещений при наступлении следующей ситуации:
 - «Недопустимые отрицательные позиции» – наличие отрицательной позиции по инструментам, по которым недопустима покупка на заемные средства (немаржинальные инструменты и инструменты типа «Д»).
- «Шаблоны уведомлений» – выбор файла для загрузки шаблона оповещения о наличии отрицательной позиции. Для выбора файла нажмите кнопку «...». Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.5](#).

Другие схемы

Оповещения для всех типов клиентов, кроме «МД».

- «Уведомлять об уровнях» – включение рассылки оповещений при достижении следующих условий:
 - * «Ограничительный уровень маржи» – уровень маржи больше или равен уровню маржи для необеспеченного требования, но меньше, чем ограничительный уровень маржи;
 - * «Уровень маржи для направления требования» – уровень маржи больше или равен уровню маржи принудительного закрытия, но меньше, чем уровень маржи для необеспеченного требования;
 - * «Уровень маржи принудительного закрытия» – уровень маржи меньше, чем уровень маржи принудительного закрытия.

(*) В справочном режиме отображаются (в процентах) значения граничных величин уровня маржи для обычных и квалифицированных клиентов. Квалифицированность клиента учитывается Модулем CoLibri только при установленном флажке «Учитывать признак квалифицированности». Значения граничных величин и признак квалифицированности клиента устанавливаются в настройках Рабочего места QUIK (пункт меню Система / Настройки / Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Клиентский портфель»).

- «Шаблоны уведомлений» – выбор файла для загрузки шаблона оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «...». Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.5](#).
- «Уведомлять о ситуациях» – включение рассылки оповещений при наступлении следующей ситуации:
 - «Доля неиспользованного глобального лимита меньше ... %» – настройка для задания предельной доли неиспользованного глобального лимита. Если фактическая доля меньше, чем заданная в настройках критическая доля неиспользованного глобального лимита, то создается оповещение.
- «Шаблоны уведомлений» – выбор файла для загрузки шаблона оповещения о наличии доли неиспользованного глобального лимита. Для выбора файла нажмите кнопку «...». Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.5](#).

6.1.2 Рассылка по e-mail

- «Отправлять как e-mail» – включение рассылки оповещений по электронной почте. По умолчанию флажок установлен. При включенном признаке доступны следующие настройки:

- «Адрес SMTP-сервера» – адрес и порт почтового SMTP-сервера, через который осуществляется рассылка электронных писем;
- «Адрес отправителя» – обратный адрес отправителя электронной почты, на который поступают ответные сообщения;
- «Авторизация на SMTP-сервере» – включение возможности авторизации пользователя на SMTP-сервере:
 - «Имя» – имя пользователя;
 - «Задать пароль» – при нажатии на кнопку открывается окно ввода пароля пользователя, в котором заполняются поля: «Новый пароль», «Подтверждение пароля». При установленном флажке «Шифровать пароль» пароль сохраняется в зашифрованном виде.

Пароль не может начинаться с символов «\$» и «#». При переносе Программы на другой компьютер, переустановке операционной системы или запуске от другого пользователя Windows, зашифрованные пароли становятся недоступными для дешифрования. В таком случае необходимо указать соответствующие пароли заново.

- «Шаблон заголовка e-mail» – шаблон заголовка электронных писем, содержащих оповещения;
- «Загружать адреса из файла» – имя файла с соответствиями кодов клиентов и их электронных адресов. Указывается вручную или выбирается, используя кнопку «...». Формат файла описан в п. [7.1](#);
- «Отправлять копии всех сообщений адресатам (через ';')» – настройка отправки копий всех сообщений по определенному набору адресов. Адреса в списке разделяются запятой («,»);
- «Отправлять при отсутствии индивидуального адреса» – настройка отправки оповещений клиентам по e-mail, даже если для клиента не задан адрес электронной почты. Оповещения отправляются только на адреса указанные в настройке «Отправлять копии всех сообщений адресатам (через ';')», а настройка «Отправлять как скрытую копию» в данном случае – игнорируется. Если для клиента задан индивидуальный адрес электронной почты, то логика отправки не меняется;
- «Отправлять как скрытую копию» – при включенном признаке оповещения по адресам, перечисленным в настройке «Отправлять копии всех сообщений адресатам (через ';')», отправляются как скрытая копия. По умолчанию флажок снят;
- «Посылать отдельные письма на разные адреса» – при включенном признаке при отправке одного оповещения сразу на несколько адресов формируется несколько писем, каждое из которых содержит только один адрес. По умолчанию флажок снят.

6.1.3 Рассылка на UID

- «Отправлять сообщения на терминалы QUIK» – включение рассылки оповещений сообщениями трейдера. По умолчанию флажок снят;
- «Рассылка через MC2Q» – включение рассылки оповещений через утилиту MC2Q;
- «Отправлять e-mail на адреса (через ‘,’)» – список адресов электронной почты через запятую («,»), на которые отсылаются сообщения для MC2Q. По умолчанию поле не заполнено. Настройка доступна при включенном признаке «Рассылка через MC2Q»;
- «Отправлять SMS» * – включение рассылки оповещений через SMS (требуется наличия SMS-шлюза). По умолчанию флажок снят;

(*) Для использования данной функции должно быть настроено соответствие клиентских кодов и UID пользователей, установлены права менеджера на класс «SMS» (обязательный флаг «Установка лимитов») в соответствии с инструкцией «Модуль SMS-уведомлений».

- «Файл с соответствиями кодов клиентов и UID» – имя файла с соответствиями кодов клиентов и UID. Указывается вручную или выбирается, используя кнопку «...». Формат файла описан в п. 7.2. Настройка доступна при включенном признаке «Отправлять сообщения на терминалы QUIK» и / или «Рассылка через MC2Q» и / или «Отправлять SMS». Поле обязательно для заполнения;
- «Сохранять файлы в каталоги (через ‘,’)» – список имен каталогов через «;» (точка с запятой) для использования в рассылке через MC2Q. По умолчанию поле не заполнено. Настройка доступна при включенном признаке «Рассылка через MC2Q».

6.1.4 Журнал отправки оповещений

- «Вести журнал отправки оповещений в БД» – при включенном признаке информация об отосланных оповещениях сохраняется в базе данных. По умолчанию флажок снят. При включенном признаке доступны следующие настройки:
 - «ODBC источник» – выбор ODBC-источника. Подробнее о создании ODBC-источника см. в п. 1.4;
 - «Имя» – имя пользователя;
 - «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, переустановке операционной системы или запуске от другого пользователя Windows, зашифрованные пароли становятся недоступными для дешифрования. В таком случае необходимо указать соответствующие пароли заново.

- «Имя таблицы» – название таблицы для сохранения оповещений. Значение по умолчанию: «MCalls». В названии таблицы недопустимы числовые значения. Формат таблицы базы данных для сохранения отосланных оповещений см. в п. [7.5](#).

6.2 Перенос позиций

- «Применять перенос для клиентов»:
 - «Только из списка» – выбор файла со списком клиентов, по которым производится перенос позиций. Формат файла описан в п. [7.3](#);
 - «Только маржинальных клиентов» – перенос позиций производится только для маржинальных клиентов;
 - «Только с положительной позицией по деньгам (для коротких позиций)» – перенос позиций производится только для клиентов с положительной позицией по деньгам;
 - «Являющихся субклиентами» – разрешить перенос позиций субклиентов. По умолчанию признак включен.
- «Настройки модифицированного РЕПО» учитывают особенности подачи заявок на этом классе бумаг, где заявка имеет минимальный размер в 1 рубль:
 - «Всегда переносить длинные позиции» – при включенном признаке заявки на перенос длинных позиций формируются в любом случае, даже если отрицательный остаток по бумагам меньше 1 рубля; при выключенном признаке заявки РЕПО формируются только в том случае, если отрицательная позиция клиента по денежным средствам больше 1 рубля;
 - «Переносить короткие позиции с оценкой менее 1 рубля» – при включенном признаке заявки на перенос коротких позиций формируются по каждой бумаге, имеющий отрицательный остаток, даже если его оценка меньше 1 рубля; при выключенном признаке заявки РЕПО формируются только в случае, если отрицательная позиция по данному инструменту имеет оценку свыше 1 рубля.
- «Параметры переноса длинных позиций»:
 - «Максимальный объем сделки» – задание максимального объема заявки по переносу длинной позиции. Заявки большего объема разбиваются на несколько заявок с объемом по каждой заявке, не превосходящим заданного максимального, последняя заявка формируется на оставшийся объем;
 - «Минимизировать количество сделок» – при включенном признаке сначала переносятся позиции по инструментам с наибольшей оценкой стоимости. По умолчанию флажок снят;

- «Переносить позиции только по маржинальным инструментам» – при включенном признаке все немаржинальные инструменты игнорируются и не участвуют в переносе позиций. По умолчанию флажок снят;
- «Списывать со счета донора средства в валюте ... по группе ...» – задание параметров списания денежных средств со счета клиента-донора при переносе позиций. Настройка позволяет задать код валюты и группу. По умолчанию значение валюты – «SUR», группы – «EQTV».
- «Проверять достаточность средств в случае единственного донора» – включение проверки достаточности средств при указании только одного клиента-донора;
- «Разрешить одновременный перенос длинных и коротких позиций» – включение допустимости одновременного переноса коротких и длинных позиций. По умолчанию флажок снят;
- «Исп. файл шаблонов ставок РЕПО» – включение использования шаблонов ставок РЕПО из указанного файла. Если заданы шаблоны ставок РЕПО, то при формировании заявок на перенос позиций параметр «Ставка РЕПО» (или «Ставка» для РПС и РПС с ЦК) может зависеть от объема заявок на перенос по данному клиенту. Выбор файла осуществляется с помощью кнопки «...». Формат файла описан в п. [7.4](#);
- «Суммировать объем длинных и коротких позиций для расчета ставки РЕПО» – в режиме переноса всех позиций для определения «Ставки РЕПО» (или «Ставки» для РПС и РПС с ЦК) используется суммарный объем всех заявок на перенос коротких и длинных позиций по клиенту;
- «Клиенты-доноры по умолчанию» – задание списка клиентов-доноров через разделитель «,» (запятая), которые по умолчанию используются при переносе позиции.

6.2.1 Дополнительные параметры

Данные параметры настраиваются, если за сделки переноса позиции брокер намеревается взимать дополнительную комиссию по сравнению с комиссией за такие сделки, не связанные с переносом позиций.

- «Дополнительная комиссия за сделки по переносу» – задание дополнительной комиссии на перенос позиций по сделкам РПС / РЕПО:
 - «Сделка на перенос длинной позиции» – величина дополнительной комиссии на перенос длинной позиции, в рублях. Значение по умолчанию: «0»;
 - «Сделка на перенос короткой позиции» – величина дополнительной комиссии на перенос короткой позиции, в рублях. Значение по умолчанию: «0».

**Величина дополнительной комиссии не списывается Сервером QUIK.
Происходит только резервирование средств под эту комиссию.**

6.2.2 Классы и бумаги

- «Классы бумаг для переноса позиций» – задание списка классов, по которым возможен перенос позиций;
- «Переносить позиции клиента по бумагам в следующем порядке» – позволяет задать последовательность перебора бумаг, позиции по которым используются для подготовки заявок.

6.2.3 Параметры заявок РЕПО

- «Параметры переноса лонгов, по умолчанию» – позволяет указать значения по умолчанию для параметров подачи заявок на перенос длинных позиций:
 - «Возмещение, %» – значение ставки возмещения, в процентах;
 - «Ставка РЕПО, %» / «Ставка, %» – значение ставки, в процентах;
 - «Ссылка» – текстовое примечание, указываемое в каждой заявке РЕПО. При экспорте сделок в бэк-офис примечание экспортируется вместе с ними и по нему можно выделить все подобные заявки.
- «Параметры переноса шортов, по умолчанию» – позволяет указать значения по умолчанию для параметров подачи заявок на перенос коротких позиций:
 - «Возмещение, %» – значение ставки возмещения, в процентах;
 - «Ставка РЕПО, %» / «Ставка, %» – значение ставки, в процентах;
 - «Ссылка» – текстовое примечание, указываемое в каждой заявке РЕПО. При экспорте сделок в бэк-офис примечание экспортируется вместе с ними и по нему можно выделить все подобные заявки.
- «Индивидуальные настройки переноса позиций по кодам клиентов» – список индивидуальных настроек представлен в виде таблицы. В каждой строке таблицы содержится информация о настройках по определенному коду клиента. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Название	Назначение
Код клиента	Код клиента
Ставка, % (длин)	Ставка РЕПО для длинных позиций, в процентах
Срок (длин)	Срок РЕПО для длинных позиций
Ставка, % (кор)	Ставка РЕПО для коротких позиций, в процентах
Срок (кор)	Срок РЕПО для коротких позиций

- «Добавить» – добавление настроек для нового кода клиента;
 - «Редакт.» – редактирование настроек для выбранного кода клиента;
 - «Убрать» – удаление выбранного кода клиента из списка;
 - «Очистить» – удаление всех кодов клиентов из списка.
- «Автовыбор знака ставки РЕПО» – если флажок установлен, то ставка РЕПО вводится в виде ее абсолютной величины. Далее для переноса коротких позиций ставка полагается отрицательной, а для переноса длинных – положительной (но отображается всегда как положительное число). По умолчанию флажок снят.

6.2.4 Внутреннее закрытие

- «Разрешить внутреннее закрытие позиций» – признак включения режима «внутреннего закрытия позиций» при переносе позиций сделками РЕПО;
- «Настройки допустимого использования средств донора» – список настроек представлен в виде таблицы. В каждой строке таблицы содержится информация о настройках по определенному коду клиента. В столбцах таблицы отображается код клиента и его доля актива в процентах. Для записей таблицы доступны следующие функции:
 - «Добавить» – добавление настроек для нового кода клиента;
 - «Редакт.» – редактирование настроек для выбранного кода клиента;
 - «Убрать» – удаление выбранного кода клиента из списка;
 - «Очистить» – удаление всех кодов клиентов из списка.

6.3 Закрытие позиций

- «Применять закрытие для клиентов» – настройка списка клиентов, по которому производится закрытие позиций:
 - «Только из списка» – выбор файла со списком клиентов, по которым производится закрытие позиций. Формат файла описан в п. [7.3](#).
- «Найти правила для клиента с кодом» – фильтр по коду клиента, используемый для быстрого поиска информации. Правила закрытия позиций настраиваются для каждого клиента в отдельном диалоге. Список правил в разрезе кодов клиентов представлен в виде таблицы. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:
 - Код клиента;
 - Тип;
 - «Д» – закрытие по дисконтам;
 - «М» – закрытие по уровню маржи.

- Резерв, % (заполняется только для закрытия позиций по дисконтам);
- Ур. Маржи, % (заполняется только для закрытия позиций по уровню маржи);
- Квал. клиенты, % (заполняется только для закрытия позиций по уровню маржи);
- Порядок закр.;
- Порядок инстр.

Описание параметров таблицы см. в п. [6.3.1](#).

- «Добавить» – добавление настроек для нового кода клиента;
- «Удалить» – удаление выбранного кода клиента из списка;
- «Изменить» – редактирование настроек для выбранного кода клиента.

Правила закрытия позиций для всех клиентов по умолчанию отображаются первыми двумя строками в списке – с кодом «Все клиенты». Первая строка с настройками для закрытия по дисконтам (Тип «Д»), вторая строка с настройками для закрытия по уровню маржи (Тип «М»). Строки не удаляются из таблицы, но доступны для редактирования. При использовании фильтра «Найти правила для клиента с кодом» (вне зависимости от его значения) строка «Все клиенты» не отображается в таблице.

Если в настройках указано, что доступен только какой-то один способ закрытия позиций (по дисконтам или по уровню маржи), то в таблице отображается запись только этого способа, включая запись «Все клиенты».

6.3.1 Окно редактирования правила закрытия позиций

Окно содержит следующие параметры:

- «Код клиента»;
- «Тип закрытия» – признак используемого типа закрытия позиций:
 - «С дисконтами» – закрытие по дисконтам;
 - «С уровнем маржи» – закрытие по уровню маржи.
- «Резерв» – процент, на который должна быть превышена начальная маржа. Положительное значение. Поле доступно при выборе типа закрытия «С дисконтами»;
- «Уровень маржи» - уровень маржи в процентах. Положительное значение с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Поле доступно при выборе типа закрытия «С уровнем маржи»;
- «Квалифицированные клиенты» – значение уровня маржи для квалифицированных клиентов. Положительное значение с точностью до двух знаков после десятичного

разделителя. Если поле не заполнено, то значение уровня маржи для квалифицированных клиентов совпадает со значением указанным в поле «Уровень маржи». Поле доступно при выполнении следующих условий:

- выбран тип закрытия «С уровнем маржи»;
 - в настройках Рабочего места QUIK (пункт меню **Система / Настройки / Основные настройки...**, раздел «Торговля» / «Клиентский портфель») установлен флажок «Учитывать признак квалифицированности»;
- «Порядок закрытия» – порядок закрытия позиций. Возможные значения:
 - «Сначала длинные»;
 - «Сначала короткие»;
 - «Все».
- «Порядок инструментов (через запятую)» – порядок создания заявок на закрытие. В поле указывается список инструментов (бумаги, валюта) через запятую – согласно последовательности инструментов. Поле недоступно при включенном флажке «Пропорционально позиции»;
- «Пропорционально позиции» – признак закрытия позиций по всем инструментам сразу пропорционально размерам позиций по которым осуществляется закрытие. По умолчанию флажок включен.

6.3.2 Параметры заявок

- «Разрешить закрытие по дисконтам» – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по дисконтам. По умолчанию флажок установлен;
- «Разрешить закрытие по уровню маржи» – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по уровню маржи. По умолчанию флажок снят;
- «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» – при установленном флажке разрешено закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам (бумаги, валюта). По умолчанию флажок снят;
- «Разрешить закрытие валютных позиций» – при установленном флажке разрешено закрытие валютных позиций. Применяется при ведении денежных позиций в разрезе валют для клиентов, использующих схему кредитования «по дисконтам» (клиенты типа «МД»). По умолчанию флажок снят;
- «Разрешить закрытие с использованием режима неполных лотов» – при установленном флажке разрешено закрытие позиций с использованием режима неполных лотов. По умолчанию флажок снят.
 - «Класс режима неполных лотов» – код класса для режима неполных лотов. Параметр доступен при включенном флажке «Разрешить закрытие с использованием режима неполных лотов» и обязателен к заполнению. Значение по умолчанию: «SMAL».

- «Защитный спрэд, %» – дополнительное (опережающее) отклонение цены закрытия заявки от текущей рыночной цены. Цена закрытия увеличивается на указанное значение в заявках на покупку и уменьшается в заявках на продажу. Значение по умолчанию: «0»;
- «Примечание к заявкам» – текст комментария в заявках на закрытие позиций. Может использоваться для идентификации заявок на закрытие позиций при интеграции с внутренними системами брокера.

6.3.3 Параметры валютного рынка

- «Инструменты для закрытия позиций на валютном рынке» – список инструментов для закрытия позиций на валютном рынке.

Список инструментов представлен в виде таблицы, в столбцах которой отображаются следующие параметры:

- «Валюта» – код валюты;
- «Пара» – код инструмента, который используется для закрытия позиции. Для каждой валюты задается один инструмент (валютная пара с расчетом T0, T1 или T2).

- 1. Если для валюты не указан допустимый для закрытия позиции инструмент, то позиция по такой валюте не закрывается.**
- 2. Валюта, в которой ведутся расчеты позиций клиента, в таблице не указывается.**

В таблице по умолчанию заданы следующие коды валют и инструменты для покупки указанных валют за рубли с расчетом T1:

Валюта	Пара
EUR	EUR_RUB__TOM
GBP	GBPRUB_TOM
USD	USD000UTSTOM

Для записей таблицы доступны следующие функции:

- «Добавить» – добавление новой валюты;
- «Редактировать» – редактирование выбранной валюты;
- «Удалить» – удаление выбранной валюты из списка;
- «Очистить» – удаление всех записей из списка.
- «Сбросить» – удаление всех записей из списка, кроме значений по умолчанию. Если значения по умолчанию редактировались, то изменения отменяются.

- «Класс для закрытия позиций» – выпадающий список для выбора класса инструментов, на котором закрываются валютные позиции. Значение по умолчанию: «CETS».

7. ПРИЛОЖЕНИЕ

7.1 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и электронных адресов

В данном файле задаются соответствия кодов клиентов и их электронных адресов. Каждая строка файла имеет вид:

```
<Код клиента_1>=<e-mail_1>, <e-mail_2>
```

или

```
<Код клиента_2>, <Фирма>=<e-mail_1>, <e-mail_2>
```

Пример:

```
E2=user1@arqa.ru, user2@arqa.ru  
E3, NC0038900000=user3@arqa.ru
```

То есть для клиента с кодом E2 рассылка должна осуществляться на электронные адреса user1@arqa.ru, user2@arqa.ru. А для клиента с кодом E3 в фирме NC0038900000 – на электронный адрес user3@arqa.ru. Если фирма не указана, то считается, что список электронных адресов указан для всех фирм.

7.2 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и UID

В данном файле задаются соответствия кодов клиентов и их идентификаторов в системе QUIK. Каждая строка файла имеет вид:

```
<Код клиента_2>=<UID_1>, <UID_2>, <UID_3>
```

или

```
<Код клиента_1>, <Фирма>=<UID_1>, <UID_2>, <UID_3>
```

Пример:

```
E2=5, 7, 85  
E3, NC0038900000=34, 127
```

То есть для клиента с кодом E2 рассылка должна осуществляться на терминалы, работающие под пользователями с UID=5, UID=7, UID=85. А для клиента с кодом E3 в фирме NC0038900000 – на терминалы, работающие под UID=34, UID=127. Если фирма не указана, то считается, что список UID указан для всех фирм.

7.3 Формат списка клиентов для переноса / закрытия позиций

Файл имеет текстовый формат. В секции [Filter] содержатся следующие параметры:

- IncludeClients – список клиентов (через запятую) для переноса / закрытия позиций («белый список»);
- ExcludeClients – список клиентов (через запятую), по которым не должны переноситься / закрываться позиции («черный список»).

Настройка IncludeClients имеет приоритет над настройкой ExcludeClients.

Формат:

```
[Filter]  
IncludeClients=Клиент1, Клиент2, Клиент3
```

7.4 Формат файла с шаблонами ставок РЕПО

Каждый шаблон описывается в файле в виде секции с названием [RepoTemplate_<Код шаблона>]. Внутри секции указываются строки, задающие размер ставки РЕПО:

- для коротких позиций, строка вида: <Оборот как целое число>=<Ставка РЕПО в %>. При оценке стоимости короткой позиции (по абсолютной величине) большей или равной указанной применяется данная ставка РЕПО;
- для длинных позиций, строка вида: Long_<Оборот как целое число>=<Ставка РЕПО в %>. При оценке стоимости длинной позиции большей или равной указанной применяется данная ставка РЕПО. Если отдельная шкала для длинной позиции в шаблоне не указана, для длинных позиций применяется та же шкала ставок, что и для коротких.

Пример:

```
[RepoTemplate_T1]
0=5
1000=4
10000=3
100000=2
Long_0=7
Long_2000=6
Long_20000=5
Long_200000=4

[RepoTemplate_T2]
0=5.1
1000=4.2
10000=3.3
100000=2
Long_0=7
Long_2000=6
Long_20000=5.1
Long_200000=4.2

[RepoTemplate_T3]
0=5.2
1000=4.3
10000=5.5
Long_0=6
Long_2000=6.4
```

В секции [Clients] файла с шаблонами задается связь между клиентами и используемыми ими шаблонами строкой следующего вида: <Код клиента>=<Код шаблона>. Таким образом, для клиента с указанным кодом должен использоваться указанный шаблон ставок РЕПО.

Пример:

```
[Clients]
```

```
E2=T1
E3=T2
__TEMPLATE__=T3
```

Для задания глобальной шкалы комиссии по ставкам РЕПО клиентам, для которых не задана индивидуальная шкала комиссии, в секции [Clients] указывается строка вида:

```
__TEMPLATE__=<Имя шаблона>
```

При этом шаблон для глобальной шкалы комиссии задается точно так же, как и для индивидуальной шкалы комиссии.

При использовании шкал комиссии по ставкам РЕПО приоритет имеет индивидуальная шкала. Если индивидуальная шкала не задана, то используется глобальная шкала комиссии. Если отсутствует и глобальная шкала, то используется ставка РЕПО, задаваемая в настройках Модуля. Как и в случае индивидуальной шкалы возможно задание различных шкал комиссии для переноса длинных и коротких позиций.

При необходимости указания ставки РЕПО, не зависящей от объема, достаточно написать в файле строку вида:

```
0=<Ставка РЕПО>
```

7.5 Формат таблицы базы данных для сохранения отосланных оповещений

В таблицу MCalls* записываются данные по отосланным уведомлениям. Таблица должна содержать следующие поля:

(*) Указано название таблицы по умолчанию. Имя таблицы может быть изменено пользователем (см. п. [6.1.4](#)).

Поле	Тип данных	Описание
ID	int, autoincrement	Номер записи в таблице. Поле заполняется автоматически

Поле	Тип данных	Описание
MCType	int, NULL	Тип оповещения (Margin call). Возможные значения: «NULL или 0» – обычные оповещения на фондовом рынке (старая схема маржинального кредитования); «1-7» – различные типы оповещений, используемые в CoLibri FM; «8» – оповещения (новая схема маржинального кредитования – «по дисконтам»)
MCTSubType	int	Подтип оповещения, только для маржин-коллов типа «по дисконтам» (MCType=8) и «по уровню маржи» (MCType=0). Возможные значения: «1» – уровень ограничения; «2» – уровень требования; «3» – уровень закрытия Выбранный уровень соответствует тому типу оповещения, который отсылается
TDate	integer	Дата формирования уведомления в формате <ГГГГММДД>
MCTime	integer	Время формирования уведомления в формате <ЧЧММСС>
MCLevel	integer	Уровень маржи, который был пробит. Возможные значения: «0» – для оповещений типа 0; «Значение зависит от типа» – для оповещений типа 1-7; «0» – для оповещений типа 8
Equity	decimal(19,4)	Стоимость портфеля
Margin	decimal(19,4)	Начальная маржа
CorrMargin	decimal(19,4)	Скорректированная маржа. Используется только для маржин-коллов типа «по дисконтам»
MinMargin	decimal(19,4)	Минимальная маржа. Для оповещений по стоимости портфеля (клиенты типа «МД»). Уровень принудительного закрытия позиции для данного клиента. Для оповещений по уровню маржи (клиенты отличные от типа «МД»)
LimitMargin	decimal(19,4)	Ограничительный уровень маржи для данного клиента
TargetMargin	decimal(19,4)	Уровень маржи для направления требования для данного клиента
DepoValue	decimal(19,4)	Средства в ценных бумагах
MoneyValue	decimal(19,4)	Текущий остаток по деньгам
CCode	varchar(12)	Код клиента
FirmID	varchar(12), NULL	Код фирмы
MsgText	varchar(255), NULL	Текст оповещения (фрагментами по 256 байт; остаток

Поле	Тип данных	Описание
MsgText2	varchar(255), NULL	игнорируется)
MsgText3	varchar(255), NULL	
MsgText4	varchar(255), NULL	
MsgText5	varchar(255), NULL	
SubjText	varchar(255), NULL	Текст заголовка сообщения при отправке e-mail
EMails	varchar(255), NULL	Первые 250 символов списка e-mail, на которые отправляются оповещения

Оповещения о наличии короткой позиции по немаржинальному инструменту и по доле использования глобального лимита не сохраняются в базу данных Модуля.

7.6 Определение статусов клиентов

Для клиентов типа «МД» определяются следующие статусы:

- «Нормальный» – стоимость портфеля больше либо равна скорректированной марже;
- «Ограничение» – стоимость портфеля меньше скорректированной маржи и больше либо равна начальной марже;
- «Требование» – стоимость портфеля меньше начальной маржи и больше либо равна минимальной марже;
- «Закрытие» – стоимость портфеля меньше минимальной маржи.

Для клиентов отличных от типа «МД» определяются следующие статусы:

- «Нормальный» – уровень маржи больше или равен ограничительному уровню маржи;
- «Ограничение» – уровень маржи больше или равен уровню маржи для необеспеченного требования, но меньше, чем ограничительный уровень маржи;
- «Требование» – уровень маржи больше или равен уровню маржи принудительного закрытия, но меньше, чем уровень маржи для необеспеченного требования;
- «Закрытие» – уровень маржи меньше, чем уровень маржи принудительного закрытия.