



Терминальный модуль риск-менеджера «CoLibri»

Руководство пользователя

Версия 4.23



Содержание

1. Общие сведения	3
1.1 Возможности программы.....	3
1.2 Принципы работы с программой.....	4
1.3 Основные окна и пункты меню программы.....	5
1.4 Подготовка к работе.....	8
2. Таблица «Заявки на перенос позиций».....	9
3. Изменения статусов клиентов	13
4. Калькулятор	15
5. Основные функции программы	18
5.1 Режим Margin Call.....	18
5.2 Перенос позиций.....	24
5.3 Заккрытие позиций.....	33
6. Настройки программы	44
6.1 Параметры рассылки оповещений	44
6.2 Перенос позиций.....	55
6.3 Перенос валютных позиций	60
6.4 Заккрытие позиций.....	66
7. ПРИЛОЖЕНИЕ	75
7.1 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и электронных адресов	75
7.2 Формат файла с соответствиями кодов клиентов и UID	75
7.3 Формат списка клиентов для переноса / закрытия позиций.....	76
7.4 Формат списка инструментов для закрытия позиций.....	76
7.5 Формата файла со списком доноров клиента.....	77
7.6 Формат файла с шаблонами ставок РЕПО	77
7.7 Формат таблицы базы данных для сохранения отправленных оповещений..	79
7.8 Определение статусов клиентов.....	81
7.9 Расчёт параметров переноса валютных позиций	82



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



1. Общие сведения

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

Термины и сокращения:

- **MarginCall2Quik** – утилита, входящая в состав программного комплекса QUIK.
- **ЕДП** – единая денежная позиция.

В данном Руководстве под «единой денежной позицией» понимается единая денежная позиция между фондовым и срочным рынками.

- **МД** – дисконтная схема ведения позиций.
- **МД+** – дисконтная схема ведения позиций с ограничением покупательной способности при помощи дисконтов по бумагам, валютам и фьючерсам с возможностью неттинга рисков по множествам инструментов.

ВАЖНО! В алгоритме закрытия позиций не учитываются настройки множеств инструментов с зависимыми ценами.

- **КПУР** – тип клиента с повышенным уровнем риска, работающего по дисконтной схеме ведения позиций «МД+».
- **КСУР** – тип клиента со стандартным уровнем риска, работающего по дисконтной схеме ведения позиций «МД+».

1.1 Возможности программы

Модуль позволяет:

- Осуществлять мониторинг денежных и депо счетов, стоимости портфеля, некоторых вычисляемых параметров и заявок клиентов на сервере QUIK;
- Осуществлять мониторинг параметров, необходимых для контроля рисков на срочном рынке;
- Отслеживать изменения уровня достаточности средств ниже контрольного уровня;
- Автоматически генерировать оповещения (Margin Call) и рассылать их пользователям сообщениями по системе QUIK, по электронной почте или SMS-сообщениями. Также поддерживается отправка оповещений по заданному расписанию и принудительная рассылка, инициируемая вручную;
- Переносить маржинальные позиции клиента сделками РЕПО и РПС различных типов;
- Формировать заявки для переноса валютных позиций клиентов на следующий день;
- 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 и риск-параметров срочного рынка

Модуль позволяет вести автоматический контроль за изменением риск-параметров фондового и срочного рынков путем использования режима Margin Call. При включенном режиме производится периодическая проверка контролируемых параметров, и рассылка уведомлений при нарушении граничных значений.

Модуль учитывает особенности расчёта показателей при использовании брокером Модуля единой денежной позиции.

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](#).

Визуальный контроль показателей осуществляется с помощью таблицы «Клиентский портфель» Рабочего места QUIK (меню **Создать окно / Клиентский портфель**).

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 или купли/продажи актива, 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, фондового и срочного 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 на фондовом рынке;
- «[Перенос валютных позиций...](#)» – открыть форму переноса позиций клиентов на валютном рынке;
- «[Заккрытие позиций...](#)» – открыть форму закрытия позиций клиентов;
- «[Настройки...](#)» – открыть окно редактирования настроек программы.

В окне создания / редактирования таблицы «Клиентский портфель» доступен дополнительный параметр:

- «Источник данных для расчетов CoLibri» – признак использования данных таблицы для расчета параметров в плагине «CoLibri». При включенном признаке в фильтре кодов позиции должен быть выбран только один код. Если при создании или редактировании таблицы с включенным признаком уже открыта другая таблица с включенным признаком, но с другими параметрами расчета, заданными в настройках «Выбор кода позиций» и «Валюта», то выводится соответствующее сообщение с предложением применить для всех таблиц параметры расчета активной таблицы. При выборе кнопки «Да» параметры расчета активной таблицы применяются для всех таблиц «Клиентский портфель». При выборе кнопки «Нет» для активной таблицы применяются ранее установленные параметры расчета.

В контекстном меню таблицы «Клиентский портфель» доступны дополнительные функции:

- «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](#), [6.1.2](#)), то появляется локальное меню для выбора типа отправляемого маржин-колла:



Для клиентов типов «МД» и «МД+», которые не имеют открытых позиций по инструментам на фондовом рынке, рассылка оповещений не производится.

- «По стоимости портфеля» * – применимо только к клиентам типов «МД» и «МД+». Пункт меню активен, если настроена рассылка хотя бы по одному из [уровней](#): ограничение, требование или закрытие;
- «По недопустимой отрицательной позиции» * – применимо только к клиентам типов «МД» и «МД+»;
- «По уровню маржи» * – применимо к клиентам всех типов, кроме «МД» и «МД+», Уведомление считается включенным, если включена рассылка хотя бы по одному из уровней маржи;
- «По доле использования глобальной позиции» * – применимо только к глобальным позициям;
- «По отрицательному остатку свободных средств» **;
- «По уровню достаточности средств» **;
- «По уровню достаточности средств (открытые позиции)» **;
- «По коэффициенту ликвидности ГО» **;
- «По ожидаемому коэффициенту ликвидности ГО» **;
- «По композитному критерию» **;
- «По произвольному риск-параметру» **.

В списке активны только те типы оповещений, отправка которых включена для данного клиента.

- «Отправить маржин-колл всем клиентам» – 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](#), [6.1.2](#)), то появляется локальное меню для выбора типа отправляемого маржин-колла:

- «По стоимости портфеля» * – применимо только к клиентам типов «МД» и «МД+». Пункт меню активен, если настроена рассылка хотя бы по одному из [уровней](#): ограничение, требование или закрытие;
- «По недопустимой отрицательной позиции» * – применимо только к клиентам типов «МД» и «МД+»;
- «По уровню маржи» * – применимо ко всем клиентам, кроме типов «МД» и «МД+», Уведомление считается включенным, если включена рассылка хотя бы по одному из уровней маржи;
- «По доле использования глобальной позиции» * – применимо только к глобальным позициям;
- «По отрицательному остатку свободных средств» **;



- «По уровню достаточности средств» **;
- «По уровню достаточности средств (открытые позиции)» **;
- «По коэффициенту ликвидности ГО» **;
- «По ожидаемому коэффициенту ликвидности ГО» **;
- «По композитному критерию» **;
- «По произвольному риск-параметру» **.

В списке активны только те типы оповещений, рассылка которых включена, и для которых выполняется условие для отправки уведомления хотя бы для одного клиента.

- «Перенести позиции по <код клиента>» / «На фондовом рынке» – открытие диалога [переноса](#) позиций на фондовом рынке для выбранного кода клиента;
- «Перенести позиции по <код клиента>» / «На валютном рынке» – открытие диалога [переноса](#) позиций на валютном рынке для выбранного кода клиента;
- «Перенести позиции по всем клиентам из таблицы» / «На фондовом рынке» – открытие диалога [переноса](#) позиций на фондовом рынке для всех клиентов, которые присутствуют в таблице «Клиентский портфель»;
- «Перенести позиции по всем клиентам из таблицы» / «На валютном рынке» – открытие диалога [переноса](#) позиций на валютном рынке для всех клиентов, которые присутствуют в таблице «Клиентский портфель»;
- «Закрыть позиции по <код клиента>» – открытие диалога [закрытия](#) позиций для выбранного клиента.
- «Закрыть позиции по всем клиентам из таблицы» – открытие диалога [закрытия](#) позиций для всех клиентов, которые присутствуют в таблице «Клиентский портфель».

(*) Данный тип оповещения применяется к клиентам с ЕДП и клиентам фондового и/или валютного рынков без ЕДП.

() Данный тип оповещения применяется к клиентам с ЕДП и клиентам срочного рынка без ЕДП.**

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
 Закрытие позиций	Открыть форму закрытия 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** права на работу с Модулем. Права могут быть установлены 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):
 - «PM CoLibri (фондовый рынок)» – доступ к уведомлениям, возможность переноса и закрытия позиций на фондовом рынке;
 - «PM CoLibri (валютный рынок)» – доступ к уведомлениям, возможность переноса и закрытия позиций на валютном рынке;
 - «PM CoLibri (срочный рынок)» – доступ к уведомлениям на срочном рынке.

Базовый функционал Модуля доступен при наличии хотя бы одной лицензии любого типа.

При использовании закрытия валютных позиций (см. п. [6.4.3](#)) 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).

При использовании Модуля единой денежной позиции настройте параметры расчёта показателей для фондового и срочного рынков. Параметры настраиваются в Библиотеке расчета лимитов на странице «Учет операций срочного рынка», см. п. 17 Руководства по настройке Библиотеки расчета лимитов.

3. Перезапустите Рабочее место QUIK для применения настроек.
4. 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».

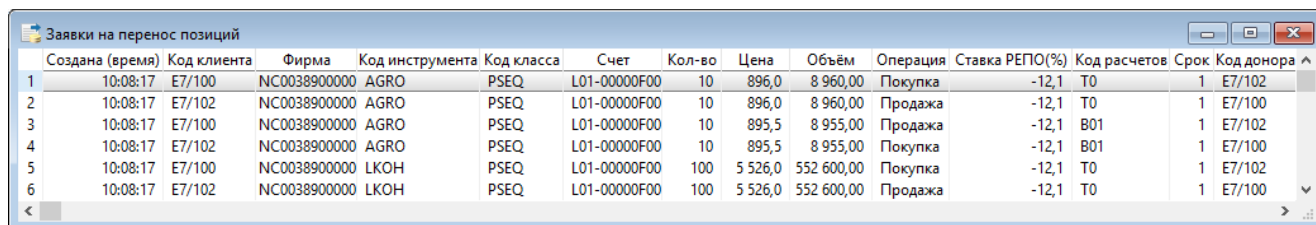
2. Таблица «Заявки на перенос позиций»

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 (время)	Код клиента	Фирма	Код инструмента	Код класса	Счет	Кол-во	Цена	Объем	Операция	Ставка РЕПО(%)	Код расчетов	Срок	Код донора
1	10:08:17	E7/100	NC0038900000	AGRO	PSEQ	L01-00000F00	10	896,0	8 960,00	Покупка	-12,1	T0	1	E7/102
2	10:08:17	E7/102	NC0038900000	AGRO	PSEQ	L01-00000F00	10	896,0	8 960,00	Продажа	-12,1	T0	1	E7/100
3	10:08:17	E7/100	NC0038900000	AGRO	PSEQ	L01-00000F00	10	895,5	8 955,00	Продажа	-12,1	B01	1	E7/102
4	10:08:17	E7/102	NC0038900000	AGRO	PSEQ	L01-00000F00	10	895,5	8 955,00	Покупка	-12,1	B01	1	E7/100
5	10:08:17	E7/100	NC0038900000	LKOH	PSEQ	L01-00000F00	100	5 526,0	552 600,00	Покупка	-12,1	T0	1	E7/102
6	10:08:17	E7/102	NC0038900000	LKOH	PSEQ	L01-00000F00	100	5 526,0	552 600,00	Продажа	-12,1	T0	1	E7/100

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

Название	Назначение
Создана (время)	Время создания заявки
Код клиента	Идентификатор клиента в системе QUIK. Для заявок донора указывается код донора
Фирма	Код фирмы
Код инструмента	Код инструмента в торговой системе



Название	Назначение
Инструмент	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 инструментов 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	Направление заявки. Возможные значения: – «Покупка»; – «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 инструментов. Для заявок донора указывается код исходного клиента
Партнер	Наименование участника торгов, которому адресована заявка
Орг-я партнера	Организация партнера
Номер	Номер заявки в торговой системе. Заполняется для поданных заявок
Состояние	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 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)



Название	Назначение
Выставлена (время)	Время выставления заявки. Заполняется для поданных заявок
Остаток	Сумма остатка. Заполняется для поданных заявок

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 заявку» – отправить в торговую систему выбранную заявку.
- «Снять заявку» – снять выбранную заявку. Доступно только для активных заявок.
- «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 неопосланные» – 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](#)).

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	



Параметр	Примечание
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; – «CCP» – 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
Состояние	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; – 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



Параметр	Примечание
	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



	Дата	Время	Код клиента	Фирма	Статус до изме	УДС до изме	Новый статус	Новый УДС
1	08.07.2014	14:17:03	Q6	SPOTFIRM	Нормальный	9.99	Закрытие	-2.41
2	08.07.2014	14:17:13	Q6	SPOTFIRM	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
Код клиента	Идентификатор клиента в системе QUIK
Фирма	Код фирмы
Тип	Тип клиента: «Д» – для схемы «По УДС» (клиенты типов «МД» и «МД+»); «М» – для схемы «По уровню маржи» (клиенты отличные от типов «МД» и «МД+»)



Название	Назначение
Статус до изменения	Для клиентов типов «МД» и «МД+» – состояние стоимости портфеля относительно уровня маржи до изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по позиции с максимальным сроком расчетов. Для клиентов отличных от типов «МД» и «МД+» – текущий уровень маржи относительно заданного уровня до изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по позиции со сроком расчетов T0. Подробнее см. п. 7.8
Новый статус	Для клиентов типов «МД» и «МД+» – состояние стоимости портфеля относительно уровня маржи после изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по позиции с максимальным сроком расчетов. Для клиентов отличных от типов «МД» и «МД+» – текущий уровень маржи относительно заданного уровня после изменения статуса клиента. Статус клиента определяется по позиции со сроком расчетов T0. Подробнее см. п. 7.8
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 типов «МД» и «МД+»
УМ до изменения	Уровень маржи позиции со сроком расчетов T0 до изменения статуса клиента. Только для схемы с уровнями маржи. Отображается в процентах. Поле заполняется для клиентов отличных от типов «МД» и «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 типов «МД» и «МД+»
Новый УМ	Уровень маржи позиции со сроком расчетов T0 после изменения статуса клиента. Только для схемы с уровнями маржи. Отображается в процентах. Поле заполняется для клиентов отличных от типов «МД» и «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. 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.

4. Калькулятор

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

4.1.1 Назначение

Маржинальный калькулятор используется для:

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

Для работы маржинального калькулятора обязательно совпадение основной валюты дисконтной схемы с базовой валютой расчёта риск-параметров (валютой расчётов в таблице «Клиентский портфель» Рабочего места QUIK).

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 окне «Маржинальный калькулятор» поля имеют следующие назначения:

- «Клиент» – ввод вручную или выбор из выпадающего списка кода клиента.
- «Инструмент» – выбор актива из выпадающего списка. В списке возможны следующие значения:
 - «Денежные средства» (по умолчанию) – суммарная позиция по деньгам (с использованием кросс-курса).
 - Коды валют – в списке отображаются коды валют позиций по деньгам клиента.
 - Коды инструментов фондового рынка – отображаются только при наличии прав на фондовый рынок (см. п. [1.4](#)).
- «Инструменты с открытой позицией» – отображать в списке «Инструмент» только те инструменты, по которым у выбранного клиента имеется позиция. По умолчанию флажок установлен. Если флажок снят, то в списке отображаются все инструменты.
- «Позиция» – позиция с максимальным сроком расчетов по выбранному клиенту и инструменту. Если у данного клиента есть несколько позиций по активу (несколько позиций по разным торговым счетам для инструментов или по кодам позиций для денег), то отображается сумма позиций по этим активам. Недоступно для редактирования.
- «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.

Расчёт для купли-продажи валютных позиций доступен только по тем валютам, по которым задан инструмент для закрытия валютных позиций (см. п. [6.4.3](#)).



Последний выбранный режим сохраняется в настройках.

- «Стоимость портфеля (Факт)» – оценка собственных средств клиента по текущим позициям и ценам, в денежном выражении. Недоступно для редактирования.
- «Стоимость портфеля (План)» – плановая оценка средств клиента в денежном выражении. Недоступно для редактирования.
- «Начальная маржа (Факт)» – фактическая величина начальной маржи. Недоступно для редактирования.
- «Начальная маржа (План)» – плановая величина начальной маржи. Недоступно для редактирования.
- «Минимальная маржа (Факт)» – фактическая величина минимальной маржи. Недоступно для редактирования.
- «Минимальная маржа (План)» – плановая величина минимальной маржи. Недоступно для редактирования.
- «Свободно (Факт)» – фактическая величина свободных активов клиента. Рассчитывается как разница показателей «Стоимость портфеля» и «Начальная маржа». Недоступно для редактирования.
- «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 клиента, инструмент, указать величину изменения позиции и нажать кнопку «Пересчитать».

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

Если требуется обновить текущие значения маржинальных показателей в калькуляторе (не меняя выбранного 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 10^{25} , то вместо числового значения в данных полях отображается значение «INF».

Если выбранный инструмент недопустим для данного способа изменения позиции, то расчёт величин не производится, и в левом нижнем углу формы выводится соответствующее предупреждение.



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).

- Оповещения по риск-параметрам фондового рынка:

Применяется к клиентам с ЕДП и клиентам фондового и/или валютного рынков без ЕДП.

Для клиентов типов «МД» и «МД+» рассылаются оповещения при снижении параметра «Стоимость портфеля» ниже значения начальной, минимальной или скорректированной маржи, а также о наличии короткой позиции по немаржинальному инструменту. Для клиентов, отличных от типов «МД» и «МД+», рассылаются оповещения при достижении уровнем маржи различных граничных значений. Возможна рассылка уведомлений по доле использования глобальной позиции.

- Оповещения по риск-параметрам срочного рынка:

Применяется к клиентам с ЕДП и клиентам срочного рынка без ЕДП.

Модуль позволяет автоматически формировать оповещения по событиям:

- Снижение уровня достаточности средств клиента ниже установленных контрольных значений;
- Исчерпание свободных денежных средств на счете клиента;
- Снижение коэффициента ликвидности ГО ниже заданного уровня;
- Значение произвольного риск-параметра.

Оповещение отправляется, если в текущий момент условие его возникновения выполняется, а в момент предыдущей проверки данное условие не выполнялось.

5.1.2 Принцип работы режима Margin call

Модуль автоматически создает и рассылает сообщения следующих типов:

- Для спот-рынка:



- 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 глобальной позиции.
- Для срочного рынка:
 - Наличие отрицательного остатка свободных средств.
 - Достижение опасного или критического уровня достаточности средств.
 - Достижение опасного или критического уровня достаточности средств, зарезервированных под открытые позиции.
 - Снижение коэффициента ликвидности гарантийного обеспечения ниже установленного уровня.
 - Снижение ожидаемого коэффициента ликвидности гарантийного обеспечения ниже установленного уровня.
 - Наличие отрицательного значения полной суммы денежных остатков или полной суммы денежных остатков на начало дня (определяется настройками, см. п. [6.1.2](#)).
 - Достижение уровня композитного критерия.
 - Снижение уровня произвольного риск-параметра ниже заданного уровня.

Рассылка оповещений возможна следующими способами:

- Электронная почта;
- Сообщения трейдера;
- SMS-сообщения;
- Сообщения через утилиту 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 клиентов типов «МД» и «МД+»:
 - 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. [6.1.1](#));



- 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 клиентов типа «МП»:
 - Оповещения по величине уровня маржи. Применимо задание минимального времени между двумя оповещениями, минимального изменения отслеживаемого параметра (см. п. [6.1.1](#)).
- Для глобальных позиций применимы следующие оповещения:
 - Оповещение по доле используемой глобальной позиции. Применимо задание минимального времени между двумя оповещениями, минимального изменения отслеживаемого параметра (см. п. [6.1.1](#)).

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.

Заголовок оповещения формируется из шаблона, указанного в настройках для данного типа оповещения (см. п. [6.1](#)). Текст отправляемого оповещения создаётся на основе шаблонов, при этом определяется какой тип шаблонов (см. п. [5.1.6](#)) должен использоваться. Для оповещений «По величине маржи» и «По уровню маржи» для каждого клиента проверяется условие на сравнение стоимости портфеля с различными типами маржи (для клиентов типов «МД» и «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 Принудительная отправка маржин-колла

Пользователь может инициировать принудительную отправку маржин-колла как одному клиенту, так и всем клиентам.

Если в настройках включен более чем один тип оповещений, то в контекстном меню таблицы «Клиентский портфель» появляется локальное меню для выбора типа отправляемого маржин-колла для конкретного клиента или для всех клиентов таблицы с учётом фильтров.

Если в настройках оповещений на странице «Параметры рассылки оповещений» (см. п. [6.1](#)) включен признак «Разрешить все типы оповещений для принудительной отправки», то в контекстном меню таблицы «Клиентский портфель» при выборе пунктов «Отправить маржин-колл для <код клиента>» или «Отправить маржин-колл всем» отображаются все типы оповещений, для которых настроены параметры отправки, даже если отправка таких оповещений выключена в настройках на страницах «Типы уведомлений спот-рынка» (см. п. [6.1.1](#)) и «Типы уведомлений срочного рынка» (см. п. [6.1.2](#)).



5.1.4 Отправка маржин-коллов по расписанию

Расписание представляет собой перечисленные через запятую моменты времени в формате <ЧЧ:ММ>, в каждый из которых следует произвести принудительную рассылку маржин-колла (подробнее об алгоритме принудительной рассылки см. п. [5.1.3](#)).

Настройка рассылки по расписанию производится в разделе **Colibri / Параметры рассылки оповещений** настроек Рабочего места QUIK отдельно для маржин-коллов каждого типа (подробнее см. п. [6.1](#)).

Автоматическая рассылка маржин-колла и рассылка по расписанию производятся независимо друг от друга.

5.1.5 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 Рабочего места QUIK). 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 Рабочего места QUIK). Подробнее см. пп. [6.1.3](#) и [6.1.4](#).

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  Margin Call 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](#).



5.1.6 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 типов «МД» и «МД+»:

Параметр	Значение
%cc	Код клиента
* %lk	Срок расчетов
%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>
%em	Список (через запятую) электронных адресов, который используется для этого клиента
%UIDs	Список (через запятую) UserID, которые используются для этого клиента
%npr1	Значение НПР1
%npr2	Значение НПР2.

* – параметры уведомления о наличии короткой позиции по немаржинальному инструменту

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



Параметр	Значение
%cc	Код клиента
%lk	Срок расчетов
%m	Текущий уровень маржи
%vd	Оценка стоимости инструментов в денежном выражении
%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 глобальной позиции:

Параметр	Значение
%lk	Срок расчетов
%val	Текущий размер неиспользованной доли глобальной позиции
%glsc	Код инструмента (для глобальной позиции по инструменту) или код валюты (для глобальной позиции по деньгам)
%glsn	Наименование инструмента (для глобальной позиции по инструменту) или код валюты (для глобальной позиции по деньгам)
%glta	Торговый счет (для глобальной позиции по инструменту) или код позиции (для глобальной позиции 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



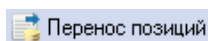
Формат файла оповещения по риск-параметрам срочного рынка:

Параметр	Значение
%cc	Код клиента
%.N][A]val	Значение отслеживаемого параметра, где: – «N» – целое число, задающее количество знаков после запятой для числовых параметров; – «A» – признак вывода абсолютного значения параметра. Части формата параметра, заключенные в квадратные скобки, являются необязательными для заполнения. Например, формат параметра для вывода значения с точностью 4 знака после запятой: «%.4val»
%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

5.2.1 Перенос позиций на фондовом рынке

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



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.

Принцип работы

Короткие позиции клиентов, не закрытые клиентом 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 инструментами или деньгами.

При переносе коротких позиций производится перенос всех отрицательных позиций клиента по инструментам. В результате выполнения данного действия создается пакет встречных заявок РЕПО (РПС), который передается на исполнение в торговую систему биржи. После исполнения второй части сделки инструменты 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 инструментов, 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 инструментам, и генерирует по ним заявки в таком объеме, чтобы привести остаток денежных средств к положительному значению.

Количество инструментов в заявках формируется с учетом кратности лота, установленной для данного инструмента. При переносе коротких позиций рассчитанное количество инструментов 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. Раздел 7 «Операции брокера», п. 7.7, п. 7.8 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 был получен отказ в ее получении), то встречная заявка от имени клиента-донора не подаётся. При этом статус встречной заявки остаётся пустым.

Перенос коротких и длинных позиций

Открытие диалога переноса позиций осуществляется следующими способами:

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

Пункты меню отображаются и доступны, если установлен флажок «Переносить позиции на фондовом рынке» в настройках Модуля (см. п. [6.2](#)).

Для переноса позиций необходимо задать список классов, по которым возможен перенос, а также приоритет использования инструментов в настройках Модуля (**Расширения / Colibri / Настройки...**, раздел Colibri / Перенос позиций / Классы и инструменты). 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).
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 инструментам (с учётом комиссий). Если для полного переноса позиций клиента инструментов 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.



Параметры переноса позиций

В окне «Перенос позиций» доступны следующие параметры:

Перенос позиций

Позиции со сроком расчетов: T0

☒ Все клиенты

☐ Длинные ☒ Короткие ☐ Все позиции

Использовать классы: РПС

PSAU, PSBB, PSDB, PSDE, PSEQ, PSOB, PSQI, PSQI_BND (8)

Указывать цену: Последней сделки

Клиенты-доноры: E7 [NC0038900000]

☐ Торговые счета совпадают с кодами клиентов

Торговый счет донора: L01+00000F00

Клиенты для внутреннего закрытия

Код расчетов: T0 Для второй части: B03

Ставка, %: 11,0000

Начальный дисконт, %

☐ Для длинных позиций определять автоматически

Ставка возмещения, %

Ссылка

Партнер: ARQA1 [MC0100000000]

Да Отмена

1. «Позиции со сроком расчетов» – выберите из списка срок расчетов, позиции с которого нужно перенести.
 - Для классов типа «Мод. РЕПО», «РПС», «РПС с ЦК», «РЕПО с ЦК» список содержит значения «T0», «T1»;
 - Для классов типа «РЕПО» список содержит значение «T0».
2. «Все клиенты» – если флажок установлен, то позиции переносятся по всем клиентам из открытых таблиц «Клиентский портфель», которые соответствуют условиям, заданным в настройках переноса позиций (см. п. [6.2](#)). Если флажок снят, то позиции переносятся по клиенту, выбранному в выпадающем списке, либо по клиентам, указанным в фильтре клиентов с помощью кнопки «...».
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 инструменты. 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» – выбор торгового счета клиента-донора из списка. 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)» – срок исполнения второй части РЕПО в днях / для классов типа «РПС с ЦК» в поле указывается количество календарных дней между текущей датой и датой исполнения вторых частей сделок (по возврату средств). Значение должно быть не более «90».
11. «Код расчетов» – код проведения расчетов по первой части сделки.

ВАЖНО! Необходимо указывать код расчетов, поддерживаемый торговой площадкой, с учетом выходных и праздничных дней.

Возможные значения:

- Для классов типа «РПС»:
 - «Т0», «В0» – для позиций «Т0»;
 - От «В01» до «В30» – для позиций «Т1».



Доступен ввод произвольного кода расчетов.

- Для классов типа «РПС с ЦК»:
 - «Y0» – для позиций «Т0»;
 - «Y1» – для позиций «Т1».
- Для классов типа «РЕПО»:
 - «R<срок РЕПО>».
- Для классов типа «Мод. РЕПО»:
 - «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 позиции доступно только одно значение кода расчетов по сделке, то это значение отображается по умолчанию без возможности редактирования.

12. «Для второй части» – код проведения расчетов по второй части сделки. Параметр доступен для классов типа «РПС».

ВАЖНО! Необходимо указывать код расчетов, поддерживаемый торговой площадкой, с учетом выходных и праздничных дней.

Возможные значения:

- От «B01» до «B30» – для позиций «Т0»;
- От «B02» до «B30» – для позиций «Т1».

Доступен ввод произвольного кода расчетов.

13. «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 установлен переключатель «Все позиции», то:

- для переноса коротких позиций используется значение ставки, указанное в данном поле;
- для переноса длинных позиций используется значение ставки, заданное в настройках по умолчанию (см. п. [6.2.1](#)).



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.

14. «Начальный дисконт, %» – условие сделки РЕПО, указывается в заявке на заключение сделки РЕПО в явном виде или однозначно определяется из условий заявки. Доступно для классов типа «Мод. РЕПО», если в качестве способа определения цены выбран вариант «Через начальный дисконт», и для классов типа «РЕПО с ЦК».

- «Для длинных позиций определять автоматически» – включить автоматический расчет дисконта при переносе длинных позиций. Флажок доступен при одновременном выполнении следующих условий:
 - Выбран тип классов «РЕПО с ЦК».
 - Выбран перенос длинных или всех позиций.
 - В настройках включен режим «Разрешить автоматический расчёт дисконта при переносе длинных позиций (только РЕПО с ЦК)» (см. п. [6.2.2](#)).

По умолчанию флажок снят.

15. «Ставка возмещения, %» – укажите ставку возмещения при невыполнении второй части РЕПО, в процентах. Доступно для классов типа «РЕПО», «Мод. РЕПО». Поле обязательно для заполнения.

Если установлен переключатель «Все позиции», то поле очищается, и используются значения ставок, заданные в настройках по умолчанию для длинных и коротких позиций (см. п. [6.2.1](#)).

Если указать в поле значение ставки, то оно используется для переноса как длинных, так и коротких позиций.

16. «Ссылка» – текст-связка для заявок РЕПО.

17. «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.



5.2.2 Перенос позиций на валютном рынке

меню **Расширения / Colibri / Перенос валютных позиций...**

Назначение

Перенос валютных позиций на следующий день для одного или нескольких клиентов по выбранной валюте.

Открытие диалога переноса позиций осуществляется следующими способами:

- Выбором пункта меню программы **Расширения / Colibri / Перенос валютных позиций...**;
- Выбором пункта контекстного меню «Перенести позиции по <код клиента>» / «На валютном рынке» в таблице «Клиентский портфель».

Пункты меню отображаются и доступны, если установлен флажок «Переносить позиции на валютном рынке» в настройках Модуля (см. п. [6.3](#)).

Переносу подлежат позиции типа TOD по всем валютам. При этом рублёвая позиция переносится в случае использования двухшаговой схемы переноса. Перенос осуществляется сделками своп TOD-TOM в адресном режиме с некоторым клиентом-донором, средства которого используются для переноса. Предполагается, что клиент-донор имеет достаточные средства для переноса всех клиентских позиций.

Применяются два режима переноса валютных позиций:

1. Обычный режим предполагает, что у клиента всегда имеется положительная позиция в рублях, достаточная для закрытия его валютных позиций. При этом отрицательные позиции по другим валютам переносятся сделкой своп по соответствующей валюте. Позиция по рублям не контролируется и может быть любой.
2. Двухшаговая схема позволяет переносить отрицательные позиции по валютам (в том числе по рублям) с помощью сделок по двум различным инструментам своп. Таким образом, для переноса позиции по долларам могут использоваться своп-инструменты USD_TODTOM и EURUSD TDTM; для переноса позиции по евро – EUR_TODTOM и EURUSD TDTM; для переноса позиции по рублям – USD_TODTOM и EUR_TODTOM. При этом контролируется, чтобы позиции по всем используемым валютам не становились отрицательными (для позиций по рублям – с учётом комиссий).
Для каждого из валютных инструментов предусмотрена возможность включения/выключения его использования при переносе позиций.

Позиции по валютам отображаются в таблице «Позиции по деньгам» отдельно по каждому коду клиента. Позиции по каждой валюте рассчитываются без привязки к тому, через какие валютные пары они приобретены.

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.



Если переносимая позиция не кратна размеру лота, то возможно использование режима мелких лотов (см. п. [6.3.2](#)).

Параметры переноса позиций

В окне «Перенос валютных позиций» доступны следующие параметры:

1. «Клиент» – позиции переносятся по клиенту, выбранному в выпадающем списке, либо по клиентам, указанным в фильтре клиентов с помощью кнопки «...». При включенной опции переноса позиций клиентов «Только из списка» (см. п. [6.3](#)) для выбора доступны только те коды клиентов, которые присутствуют в указанном в настройках файле. В списке доступных клиентов после кода клиента в скобках указан идентификатор фирмы. Если выбрано более одного клиента, то в поле отображается количество выбранных клиентов.
2. «Класс» – наименование класса, к которому относится инструмент. По умолчанию отображается класс для переноса позиций, указанный в настройках (см. п. [6.3](#)).
3. «Торговый счёт» – торговый счет, по которому создаются заявки для переноса валютных позиций.
4. «Определять автоматически» - признак автоматического определения торгового счета. При установленном флажке используется торговый счет из позиции клиента по инструменту класса с типом «Валюта». Если позиция по инструменту класса с типом «Валюта» отсутствует, то используется торговый счет из позиции по инструменту класса другого типа. По умолчанию флажок снят.
5. «Валюта» – валюта, позиции по которой необходимо перенести.
6. «Донор»:
 - «Клиент» – код участника торгов, средства которого используются для переноса позиций.



- «Торговый счёт» – торговый счет участника торгов, средства которого используются для переноса позиций.

Связка кода донора и его торгового счёта сохраняется в файле конфигурации, значения автоматически подставляются в соответствующие поля при следующем открытии диалога.

- 7.** «Инструмент» – инструмент сделки своп, по которому будут подготовлены заявки на перенос позиций.

Если включена двухшаговая схема переноса позиций, то для каждого из шагов отображается следующая информация:

- наименование своп-инструмента. Использование инструмента при переносе позиций может быть включено/выключено с помощью флажка слева.
- направление первой части сделки, код валюты своп-инструмента и значение ставки по умолчанию для цены второй части сделки по валютному свопу.

Если включен режим использования мелких лотов, то в поле отображаются обычный инструмент и инструмент мелких лотов (если они заданы в настройках, см. п. [6.3.2](#)).

- 8.** «Цена» – цена сделки своп. При указании цены значение параметра «Ставка, %» пересчитывается автоматически (формулу пересчёта см. в п. [7.9](#)).
- 9.** «Ставка, %» – ставка для определения цены второй части сделки по валютному свопу в процентах годовых. При указании ставки значение параметра «Цена» пересчитывается автоматически (формулу пересчёта см. в п. [7.9](#)).

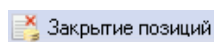
Значение ставки указывается в информационном режиме, в торговую систему биржи передаётся значение из поля «Цена».

- 10.** «Использовать значения по умолчанию» – признак использования для переноса значений ставок, заданных по умолчанию (см. пп. [6.2.1](#), [6.3.1](#)). Значения по умолчанию указаны слева от признака: если выбран один клиент, и для него заданы индивидуальные настройки, то отображается значение ставки, заданное для выбранного клиента, иначе используются глобальные настройки.

Для создания заявок нажмите кнопку «Да». Чтобы закрыть окно без отправки заявок, нажмите «Отмена».

5.3 Закрытие позиций

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



5.3.1 Назначение

Процедура закрытия позиций может применяться при достижении клиентом условия, при котором требованиями брокера или регулятора необходимо закрыть позиции (или их часть)



для достижения допустимого состояния. Запуск процедуры закрытия позиций осуществляется командой сотрудника брокера.

5.3.2 Принцип работы

В настройках клиентского места (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки / Colibri / Закрытие позиций**) назначаются правила, по которым создаются заявки (см. п. [6.4](#)).

Создание заявок осуществляется в диалоге «Закрытие позиций», который можно открыть следующими способами:

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

В открывшемся диалоге настраиваются параметры закрытия позиций, выбирается список клиентов и рынков, для которых требуется закрытие позиций.

По умолчанию используется шаблон с признаком «Основной», указанный для данного типа закрытия позиций, или индивидуальная настройка, заданная на код клиента (см. п. [6.4.1](#)). Шаблон может быть изменён для текущей операции. В этом случае индивидуальные настройки игнорируются, и выбранный шаблон применяется ко всем клиентам, попадающим под закрытие данного типа.

Основная валюта дисконтной схемы должна совпадать с базовой валютой расчёта риск-параметров (валютой расчётов в таблице «Клиентский портфель» Рабочего места QUIK). Иначе выводится соответствующее предупреждение, и диалог «Закрытие позиций» не открывается.

При нажатии кнопки «Рассчитать» для выбранных клиентов и рынков формируются заявки на закрытие позиций:

1. Определяется список инструментов, позиции по которым требуется закрыть.

Если валютная пара связывает две валюты с нулевым дисконтом, то такая позиция при закрытии игнорируется.

Подробнее об алгоритмах закрытия позиций по УДС и уровню маржи см. в п. [5.3.4](#).

2. Список инструментов сортируется в соответствии с одним из следующих алгоритмов:

- Минимальный оборот – позиции закрываются по всем инструментам сразу, с минимальным оборотом по сделкам, которые создаются при закрытии позиций клиента;
- Пропорционально позиции – все позиции уменьшаются на одну и ту же долю в денежной оценке;



- Заданный 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.

3. Рассчитываются заявки 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 такая позиция пропускается.

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

При нажатии кнопки «Выполнить» выполняется проверка на возможность закрытия позиций по выбранным инструментам:

- Если есть позиции по немаржинальным инструментам или инструментам типа «Д», не кратные размеру лота, и при этом закрытие по режиму неполных лотов не используется, то выдаётся соответствующее предупреждение со списком кодов клиентов, для которых закрытие позиций невозможно.
- Если есть позиции по немаржинальным инструментам или инструментам типа «Д», кратные размеру лота, или используется закрытие по режиму неполных лотов, то выдаётся соответствующее предупреждение, содержащие список кодов клиентов, с возможностью закрытия позиций или возврата в диалог редактирования параметров закрытия.

Если проверка пройдена, то 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.

При наличии отвергнутых заявок и/или клиентов, по которым закрытие позиций проведено не полностью (не найден инструмент или валютная пара, инструмент признан недопустимым для закрытия), выводится соответствующее предупреждение, содержащее:

- Количество и перечень кодов клиентов, для которых отправлены заявки на закрытие позиций;
- Количество и перечень кодов клиентов, заявки которых отвергнуты;
- Количество и перечень кодов клиентов, имеющих недостаточно активов для закрытия до требуемого состояния.



5.3.3 Параметры диалога «Закрытие позиций»

Окно закрытия позиций содержит следующие параметры:

Закрытие позиций

Закрытие позиций для клиентов

☒ с кодами E7/37 [NC0038900000] ...

☐ с УДС больше 0,00 и меньше 1,00

☐ с УМ больше 25,00 и меньше 50,00

☐ срочного рынка с больше и меньше

Дополнительные условия Задать фильтры...

Шаблон для закрытия <По умолчанию> ... По умолчанию

Закрытие позиций ☒ Фондовый рынок ☒ Валютный рынок ☒ Срочный рынок

☐ Закрывать позиции только немаржинальными инструментами

☒ Закрывать положительные позиции по немаржинальным инструментам

☐ Закрывать положительные позиции с учётом позиций по валютам

	Код клие	Код клас	Класс	Код инструмент	Инструмент	Счет	Операция	Цена	Кол-во	Объем	НКД	Комиссия
1	E7/37	TQBR	МБ ФР: Т+ А1	MSNG	+МосЭнергоМосЭнерго акции	L01-00000F00	Продажа	2,0860	1	2 086,00		0,22
2	E7/37	TQOB	МБ ФР: Т+ А1	SU26205RMFS3	ОФЗ 26205	ОФЗ-ПД 26205 14/	Продажа	101,8930	1	1 018,93	19,16	0,11

Рассчитать Выполнить Отменить

1. «Закрытие позиций для клиентов» – задание списка клиентов для закрытия позиций:

- «с кодами» (по умолчанию) – выбор одного кода клиента из выпадающего списка или нескольких кодов клиентов с помощью кнопки «...».

Если форма закрытия позиций открыта из таблицы «Клиентский портфель» выбором пункта контекстного меню «Закрыть позиции по <код клиента>», то по умолчанию в поле указан код клиента из выбранной строки таблицы.

Если форма закрытия позиций открыта из таблицы «Клиентский портфель» выбором пункта контекстного меню «Закрыть позиции по всем клиентам из таблицы», то по умолчанию в поле выбран список всех клиентов, которые присутствуют в данной таблице, а также в файле со списком клиентов при включенной опции закрытия позиций «Только из списка» (см. п. 6.4).

- «с УДС больше ... и меньше ...» – выбор клиентов с учетом минимального и/или максимального уровней достаточности средств. Значения в полях указываются с точностью до двух знаков после десятичного разделителя и не могут быть больше «1». В фильтр попадают только клиенты типа «МД» и «МД+». Поле активно, если в настройках (см. п. 6.4) разрешено закрытие позиций по УДС;
- «с УМ больше ... и меньше ...» – выбор клиентов для закрытия позиций с учетом минимального и/или максимального уровней маржи. Значения в полях указываются в процентах и не могут быть больше «100». В фильтр попадают все типы клиентов, кроме «МД» и «МД+». Поле активно, если в настройках (см. п. 6.4) разрешено закрытие позиций по уровню маржи;



- «срочного рынка с ... больше ... и меньше ...» – выбор клиентов срочного рынка (включая клиентов с единой позицией), с учетом минимального и/или максимального значений риск-параметра, для закрытия позиций (подробнее см. в п. 6.4).

2. «Дополнительные условия» – дополнительные условия выбора клиентов с помощью фильтров по типу клиента и типу имеющихся у клиента позиций. При выборе параметра закрытия позиций для клиентов «с кодами» фильтры недоступны. Фильтры настраиваются с помощью кнопки «Задать фильтры...». Набор выбранных фильтров отображается в поле справа:

- «Фондовый рынок» / «Валютный рынок» / «Срочный рынок» – если выбран соответствующий тип позиции. Если выбраны все типы позиций, то отображается значение «Все позиции»;
- «Единая позиция» / «Раздельная позиция» – если выбран соответствующий тип клиента. Если выбраны все типы, то значение не отображается;
- «Фирмы: <список кодов фирм>» / «Фирмы: кроме <список кодов фирм>» – если настроен включающий / исключающий фильтр по фирмам.

Окно «Установка фильтров» содержит следующие поля:

- «По наличию позиции» – настройка фильтрации по наличию у клиентов позиций и соответствующих лицензий на типы рынков. Для закрытия позиций выбираются коды клиентов, для которых выполняются все включенные условия:
 - «Фондовый рынок» – имеется хотя бы одна позиция по инструментам и лицензия на фондовый рынок. По умолчанию флажок установлен;
 - «Валютный рынок» – имеется хотя бы одна позиция по деньгам (из числа валют, по которым в настройках указано закрытие позиций) и лицензия на валютный рынок. По умолчанию флажок снят;
 - «Срочный рынок» – имеется хотя бы одна позиция по клиентским счетам (позиция по срочному активу) и лицензия на срочный рынок. По умолчанию флажок снят.
- «По типу клиента» – настройка фильтрации по наличию у клиентов единой денежной позиции. Для закрытия позиций выбираются коды клиентов, для которых выполняются все включенные условия:
 - «Имеется единая позиция»;
 - «Нет единой позиции».



По умолчанию все флажки установлены.

- «Фильтр по фирме» – включение фильтрации фирм для закрытия позиций. Окно настройки фильтра открывается с помощью кнопки «...». По умолчанию флажок снят (позиции закрываются по всем фирмам).

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» с установленным признаком «Источник данных для расчетов CoLibri», то формируется единый список допустимых клиентов по всем таблицам.

3. «Шаблон для закрытия» – изменение правила закрытия позиций, настроенного по умолчанию, для текущей операции закрытия. Описание настройки шаблонов см. в п. [6.4.1](#).

При нажатии кнопки «...» открывается таблица «Шаблоны закрытия» для выбора шаблона. Описание параметров, приведённых в таблице, см. в п. [6.4.1](#). Редактирование настроек не изменяет параметры закрытия, заданные в настройках программы.

Для возврата к настройкам по умолчанию нажмите кнопку «По умолчанию». По умолчанию используются следующие шаблоны:

- Для клиентов фондового рынка типов «МД» и «МД+» (включая клиентов с ЕДП) – «основной» шаблон, установленный для типа закрытия «По УДС» (см. п. [6.4.1](#)).
- Для клиентов фондового рынка всех типов, кроме «МД» и «МД+» – «основной» шаблон, установленный для типа закрытия «По уровню маржи» (см. п. [6.4.1](#)).
- Для клиентов срочного рынка всех типов, кроме «МД» и «МД+» (без ЕДП) – «основной» шаблон, установленный для типа закрытия «На срочном рынке» (см. п. [6.4.1](#)).

4. «Закрытие позиций» – выбор рынков для закрытия позиций:

- «Фондовый рынок»;
- «Валютный рынок»;
- «Срочный рынок».

По умолчанию все флажки установлены.

5. «Закрывать только немаржинальными инструментами» – при включённом признаке закрытие позиций (как положительных, так и отрицательных) на фондовом и валютном рынках осуществляется только немаржинальными инструментами. Доступен, если в настройках закрытия включён режим «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» (см. п. [6.4](#)). По умолчанию флажок снят. Если флажок установлен, то признак «Закрывать положительные позиции по немаржинальным инструментам» включён и недоступен.
6. «Закрывать положительные позиции по немаржинальным инструментам» – при включённом признаке допустимо использование положительных позиций по



немаржинальным инструментам в текущей операции закрытия позиций на фондовом и валютном рынках. Редактирование настроек не изменяет параметры закрытия, заданные в настройках программы. Если в настройках закрытия включён режим «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» (см. п. [6.4](#)), то флажок по умолчанию установлен, иначе – снят.

Если флажок «Закрывать только немаржинальными инструментами» установлен, то признак включён и недоступен.

- 7.** «Закрывать положительные позиции с учётом позиций по валютам» – если флажок установлен, то при закрытии положительных позиций на фондовом рынке заявки формируются на объём, достаточный для закрытия отрицательной позиции по валюте, в которой торгуется инструмент. Если в настройках закрытия включён режим «Разрешить закрытие положительных позиций с учётом позиций по валютам» (см. п. [6.4](#)), то флажок по умолчанию установлен, иначе – снят.
- 8.** Таблица заявок на закрытие позиций содержит следующие поля:

- Код клиента;
- Код класса;
- Класс;
- Код инструмента;
- Инструмент сокр.;
- Инструмент;
- Счет;
- Операция;
- Цена в валюте расчетов (для облигаций в процентах);
- Кол-во в лотах;
- Комиссия;
- Объем в валюте расчетов;
- НКД в валюте расчетов.

Операции, выполняемые из контекстного меню таблицы:

- «Изменить» – изменить параметры заявки. Пункт меню доступен в колонках «Цена» и «Кол-во». В колонке «Кол-во» можно указать только положительное значение, а в колонке «Цена» – как положительное (для всех типов инструментов), так и отрицательное или нулевое значение (только для инструментов срочного рынка).

Для сохранения значений нажмите ENTER или TAB. Режим редактирования также включается двойным щелчком мыши на заявке.

- «Удалить» – удалить заявку из списка;
- «Редактировать таблицу» – редактирование списка полей, отображаемых в таблице.



Для расчёта заявок для закрытия нажмите кнопку «Рассчитать» (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».

5.3.4 Алгоритм закрытия позиций

В зависимости от типа клиента и параметров закрытия закрытие позиций на разных рынках может осуществляться отдельно или [одновременно](#).

ВАЖНО! В алгоритме закрытия позиций не учитываются настройки множеств инструментов с зависимыми ценами.

Закрытие позиций на фондовом рынке

- По УДС:
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 (настройка «Резерв» в окне «Редактирование правила закрытия позиций», см. п. [6.4.1](#)).

(*) При закрытии позиций в режиме «до нормального статуса» маржинальный статус клиента типа «КПУР» в схеме «МД+» изменяется таким образом, чтобы стоимость его портфеля превышала значение минимальной маржи.

Закрытие позиций клиентов типов «КСУР» и «КПУР» в режиме «до заданного значения УДС» осуществляется до достижения заданного значения УДС.

Заявки на закрытие позиций формируются следующим образом:

- Формируются заявки на закрытие отрицательных позиций по немаржинальным инструментам или инструментам типа «Д» для клиентов. Для клиентов, не имеющих отрицательных позиций по немаржинальным инструментам, формируются заявки 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. [6.4](#)).
- При включении режима «Закрывать только немаржинальными инструментами» (см. п. [5.3.3](#)) закрытие позиций на фондовом и валютном рынках осуществляется только немаржинальными инструментами. Позиции по другим инструментам игнорируются.



Если включен режим «Закрывать только немаржинальными инструментами», то при наличии отрицательных позиций по инструментам типа «Д» закрытие позиций невозможно.

- Если включен параметр «Закрывать положительные позиции с учётом позиций по валютам» (см. п. [5.3.3](#)), то при закрытии положительных позиций на фондовом рынке накладывается ограничение, которое позволяет объём продажи, не превышающий отрицательную позицию по соответствующей валюте.
- Для каждого инструмента определяется режим торгов, по которому будет производиться закрытие. Позиции со сроками расчетов, отличными от срока расчетов, соответствующего этому режиму торгов, игнорируются.

Для закрытия позиций на фондовом рынке по УДС в настройках Модуля (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки...**, раздел Colibri / Закрытие позиций) должны быть включены флажки «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» и «Разрешить закрытие по УДС».

- По уровню маржи:

Доведение текущего уровня маржи клиента до заданного брокером. Если текущий уровень маржи клиента больше или равен заданному уровню маржи, то закрытие позиций по клиенту не производится.

Заявки на закрытие позиций формируются следующим образом:

- Формируются заявки на закрытие отрицательных и положительных позиций по инструментам типа «М» или «МО». Разрешение на закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам устанавливается включением признака «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» (см. п. [6.4](#)).
- При включении режима «Закрывать только немаржинальными инструментами» (см. п. [5.3.3](#)) закрытие позиций на фондовом и на валютном рынках осуществляется только немаржинальными инструментами. Позиции по другим инструментам игнорируются.
- Если включён параметр «Закрывать положительные позиции с учётом позиций по валютам» (см. п. [5.3.3](#)), то при закрытии положительных позиций на фондовом рынке накладывается ограничение, которое позволяет объём продажи, не превышающий отрицательную позицию по соответствующей валюте.
- Для каждого инструмента определяется режим торгов, по которому будет производиться закрытие, и проверяется соответствующая этому режиму позиция. Позиции со сроками расчетов, отличными от T0, игнорируются.

Для клиентов всех типов, кроме «МД» и «МД+», имеющих ЕДП, при закрытии учитываются только позиции на фондовом рынке. Валютные позиции и позиции на срочном рынке игнорируются.

Для закрытия позиций на фондовом рынке по уровню маржи в настройках Модуля (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки...**, раздел Colibri / Закрытие позиций) должны быть включены флажки «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» и «Разрешить закрытие по уровню маржи».



Заккрытие валютных позиций

Валютные позиции закрываются для клиентов фондового рынка типов «МД» и «МД+» (использующих схему «По УДС»).

При закрытии валютных позиций закрываются все позиции, для которых в настройках закрытия позиций (см. п. [6.4.3](#)) указаны подходящие валютные пары. Логика закрытия валютных позиций аналогична логике закрытия позиций на фондовом рынке.

Для валютных позиций типы инструментов (и размеры дисконтов) берутся непосредственно с валют, а не с соответствующих им инструментов типа «валютная пара».

Для закрытия валютных позиций в настройках Модуля (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки...**, раздел Colibri / Заккрытие позиций) должен быть включен флажок «Разрешить закрытие позиций на валютном рынке».

Алгоритм закрытия позиций на фондовом рынке по УДС аналогичен алгоритму [закрытия нескольких типов позиций](#).

Если закрываемая валютная позиция не кратна размеру лота, то возможно использование режима мелких лотов (см. п. [6.4.3](#)).

Заккрытие позиций срочного рынка

Заккрытие позиций осуществляется с применением шаблона «По срочному рынку» и используется для клиентов срочного рынка.

Заккрытие позиций на срочном рынке доступно для клиентов с ЕДП, если в настройках правила закрытия позиции (см. п. [6.4.1](#)) выключена настройка «При наличии единой позиции применять к позициям срочного рынка» (или если включена, но при этом отсутствуют ненулевые позиции на фондовом или валютном рынках и выключена настройка «Применять при отсутствии спот-позиций»).

Для клиентов с ЕДП сначала производится закрытие позиций на фондовом и валютном рынках, а затем – на срочном рынке.

В соответствии с шаблоном закрытия по срочному рынку определяется риск-параметр срочного рынка и его значение, которое должно быть достигнуто для закрытия позиций.

Определяется список инструментов, позиции по которым требуется закрыть, на основании шаблона закрытия по срочному рынку. Заявки на закрытие позиций подготавливаются только по фьючерсным контрактам. Позиции по опционам учитываются, если включена настройка «Разрешить закрытие позиций по опционам» (пункт меню **Расширения / Colibri / Настройки...**, раздел Colibri / Заккрытие позиций, подробнее см. п. [6.4](#)).

Для каждой позиции проверяется, можно ли закрытием очередной позиции достичь целевого значения риск-параметра:



- Если целевое значение не достигнуто, то позиция закрывается полностью, и происходит переход к следующей позиции.
- Если полное закрытие текущей позиции превосходит требуемое значение риск-параметра, то вычисляется минимальное закрытие текущей позиции, необходимое для достижения целевого значения риск-параметра.

Закрытие нескольких типов позиций

Для клиентов типов «МД» и «МД+» возможно одновременное закрытие позиций на фондовом, валютном и срочном рынках при наличии соответствующих настроек (см. п. [6.4](#)). Для одновременного закрытия позиций применяется шаблон «По УДС».

Закрытие позиций на срочном рынке доступно для клиентов с ЕДП, если в настройках правила закрытия позиции (см. п. [6.4.1](#)) включена настройка «При наличии единой позиции применять к позициям срочного рынка», а также либо имеется ненулевая позиция на фондовом или валютном рынках, либо включён флажок «Применять при отсутствии спот-позиций».

Список инструментов сортируется в соответствии с одним из следующих алгоритмов (подробнее см. в п. [6.4.1](#)):

- «Минимальный оборот» – позиции, имеющиеся у клиента, перебираются в порядке убывания объёма начальной маржи за один лот для инструментов фондового/валютного рынка и величины ГО за один контракт для инструментов срочного рынка. Учитывается значение настройки [«Порядок закрытия»](#).
- «Пропорционально позиции» – позиции, имеющиеся у клиента, перебираются в порядке убывания объёма начальной маржи за один лот для инструментов фондового/валютного рынков и величины ГО за один контракт для инструментов срочного рынка. Все позиции уменьшаются на одну и ту же долю в денежной оценке. Учитывается значение параметра [«Порядок закрытия»](#).
- «Заданный порядок инструментов».

Для каждой позиции проверяется, можно ли закрытием очередной позиции достичь целевого значения риск-параметра:

- Если целевое значение не достигнуто, то позиция закрывается полностью, и происходит переход к следующей позиции.
- Если полное закрытие текущей позиции превосходит требуемое значение риск-параметра, то вычисляется минимальное закрытие текущей позиции, необходимое для достижения целевого значения риск-параметра.



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

Вкладка «Параметры рассылки оповещений» содержит следующие настройки:

- «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 типов «МД» и «МД+». Значение 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.

- «Разрешить все типы оповещений для принудительной отправки» – возможность отправки оповещения вручную при отключенном оповещении соответствующего типа. По умолчанию признак выключен.
- «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.
- «Список шаблонов для рассылки (через `;`)'» – список шаблонов (размеров плеча) через разделитель «;». Уведомления отправляются клиентам, у которых задано плечо из списка. Для настройки списка шаблонов нажмите на кнопку «...» и в открывшемся окне введите значения размеров плеча через разделитель «;».

6.1.1 Типы уведомлений спот-рынка

Схема с дисконтами

Вкладка «Схема с дисконтами» содержит параметры настройки оповещений для клиентов типов «МД» и «МД+»:

- «Фирма» – список кодов фирм для индивидуальной настройки оповещений:
 - «По умолчанию» – параметры настройки оповещений для фирм по умолчанию, для которых не заданы индивидуальные настройки оповещений. Строка не может быть удалена из списка, но доступна для редактирования.
 - «Добавить» – добавление кода фирмы;
 - «Переименовать» – переименование кода фирмы;
 - «Удалить» – удаление выбранного кода фирмы из списка;
 - «Очистить» – удаление всех кодов фирм из списка.
- «Шаблоны уведомлений» – выбор файла для загрузки шаблона оповещения для каждого из условий в рамках «Уведомлять об уровнях» и «Уведомлять о ситуациях». Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблоны для SMS» – выбор файла для загрузки шаблона SMS-оповещения для каждого из условий в рамках «Уведомлять об уровнях» и «Уведомлять о ситуациях». Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата



кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.

- «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.
- «Уведомлять о ситуациях» – включение рассылки оповещений при наступлении следующей ситуации:
 - «Недопустимые отрицательные позиции» – наличие отрицательной позиции по инструментам, по которым недопустима продажа в шорт (немаржинальные инструменты и инструменты типа «Д»).
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Другие схемы

Вкладка «Другие схемы» содержит параметры настройки оповещений для всех типов клиентов, кроме «МД» и «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 (в процентах) режиме отображаются 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 /



- «Шаблоны уведомлений» – файл для загрузки шаблона оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблоны для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Уведомлять о ситуациях» – включение рассылки оповещений при наступлении следующей ситуации:
 - «Доля неиспользованной глобальной позиции меньше ... %» – настройка для задания предельной доли неиспользованной глобальной позиции. Если фактическая доля меньше, чем заданная в настройках критическая доля неиспользованной глобальной позиции, то создается оповещение.
- «Шаблоны уведомлений» – файл для загрузки шаблона оповещения о наличии доли неиспользованной глобальной позиции. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблоны для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения о наличии отрицательной позиции. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')`» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

6.1.2 Типы уведомлений срочного рынка

Отриц. остаток свободных средств

- «Уведомлять об отрицательном остатке свободных средств» – включение рассылки оповещений при достижении следующего условия:

– «Планируемые чистые позиции» < 0.

По умолчанию флажок снят.



- «Шаблон уведомления» – файл для загрузки шаблона оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблон для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через ',')» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Уровень дост. средств

- «Уведомлять об уровнях» – включение рассылки оповещений при достижении опасного или критического уровня достаточности средств:
 - «Опасный» – уровень достаточности средств, на котором необходимо предупредить клиента. По умолчанию флажок снят. При установленном флажке значение по умолчанию: «1»;
 - «Критический» – уровень достаточности средств, на котором клиенту закрывают позицию. По умолчанию флажок снят. При установленном флажке значение по умолчанию: «0»;
- «Шаблоны уведомлений» – файл для загрузки шаблона оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблоны для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения для каждого из условий. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Не рассылать, если коэффициент ликвидности ГО больше» – отключение рассылки оповещений, если коэффициент ликвидности ГО больше указанного значения. По умолчанию флажок снят. При установленном флажке значение по умолчанию: «1».
- «Рассылать уведомления об опасном уровне по расписанию (чч:мм через ',')» – включение принудительной отправки маржин-коллов об опасном уровне достаточности средств по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Рассылать уведомления о критическом уровне по расписанию (чч:мм через ',')» – включение принудительной отправки маржин-коллов о критическом уровне



достаточности средств по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.

- «Шаблон заголовка e-mail опасного уровня» – заголовок сообщения при отправке уведомления об опасном уровне достаточности средств по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».
- «Шаблон заголовка e-mail критического уровня» – заголовок сообщения при отправке уведомления о критическом уровне достаточности средств по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Уровень дост. средств (под откр. поз.)

На странице настраиваются параметры отправки сообщений при достижении опасного или критического уровня достаточности средств, зарезервированных под открытые позиции.

Параметры настройки данного типа маржин-коллов аналогичны параметрам настройки маржин-коллов типа «Уровень дост. средств» (см. выше).

Коэф. ликвидности ГО

- «Уведомлять об уровне коэффициента ликвидности ГО» – включение рассылки оповещений при выполнении одного из следующих условий:
 - Снижение коэффициента ликвидности гарантийного обеспечения ниже значения, указанного в поле справа;
 - Отрицательное значение полной суммы денежных остатков, выбранной в настройке «Контролировать положительное значение».

По умолчанию флажок снят. При установленном флажке значение по умолчанию: «0».

- «Шаблон уведомления» – файл для загрузки шаблона оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблон для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Контролировать положительное значение» – тип полной суммы денежных остатков для контроля положительного значения:
 - «Полная сумма денежных остатков» (по умолчанию);
 - «Полная сумма денежных остатков на начало дня».
- «Добавлять к значению вариационную маржу и накопленный доход» – выбранное значение полной суммы денежных остатков суммируется со значениями реальной вариационной маржи и накопленного дохода. По умолчанию флажок снят.



- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')`» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Ожид. коэф. ликвидности ГО

- «Уведомлять об уровне ожидаемого коэффициента ликвидности ГО» – включение рассылки оповещений при снижении ожидаемого коэффициента ликвидности гарантийного обеспечения ниже значения, указанного в поле справа. По умолчанию флажок снят. При установленном флажке значение по умолчанию: «0».
- «Шаблон уведомления» – файл для загрузки шаблона оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблон для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')`» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Композитный критерий

- «Уведомлять о достижении уровня композитного критерия» – включение рассылки оповещений при наступлении выбранных условий. Рассылка оповещений включается отдельно для клиентов разных типов с помощью флажков:

- «Использовать для клиентов с единой позицией и схемой с дисконтами»;
- «Использовать для клиентов с единой позицией и другими схемами»;
- «Использовать для клиентов срочного рынка без единой позиции».

По умолчанию флажок «Использовать для клиентов с единой позицией и схемой с дисконтами» установлен, остальные флажки сняты.

Для каждого типа клиентов настраиваются условия рассылки оповещений:

- «Риск-параметр» - риск-параметр, значение которого используется при проверке условия оповещения. По умолчанию используется риск-параметр «Планируемые чистые позиции» со значением «0» в условии оповещения;



- «Условие оповещения» - оповещение отправляется, если фактическое значение риск-параметра меньше значения, заданного в поле. Значение задается в виде числа с двумя знаками после запятой. Поле обязательно для заполнения.

- 1. При выборе риск-параметра «Стоимость портфеля» поле недоступно для редактирования; оповещение отправляется, если фактическое значение параметра меньше значения скорректированной маржи.**
- 2. При выборе риск-параметров «Текущие чистые позиции», «ГО поз.» и «ГО заяв.» оповещение отправляется, если фактическое значение параметра больше заданного значения.**

- «Доп. условие по», «Предельное значение» - настройка дополнительных условий на проверку выполнения условия оповещения.

Оповещение отправляется, если выполняются все заданные условия, как главное, так и дополнительные.

- «Шаблон уведомления» – файл для загрузки шаблона оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблон для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')`» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

Произвольный параметр

- «Уведомлять об уровне риск-параметра» – включение рассылки оповещений при уменьшении показателя риск-параметра ниже уровня, заданного в настройках. По умолчанию флажок снят.
- «Риск-параметр» – выбор риск-параметра из выпадающего списка.
- «Уровень параметра создания уведомления» – значение параметра, выбранного в поле «Риск-параметр». При снижении показателя ниже заданного уровня происходит отправка оповещения. Значение по умолчанию: «0».



Для параметров «ТекЧистПоз», «ГО поз.», «ГО заяв.» рассылка оповещений происходит при увеличении показателя риск-параметра выше уровня, заданного в настройках.

- «Только для клиентов с единой позицией» – признак отправки сообщений только клиентам с единой денежной позицией. По умолчанию флажок снят.
- «Шаблон уведомления» – файл для загрузки шаблона оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#).
- «Шаблон для SMS» – файл для загрузки шаблона SMS-оповещения. Для выбора файла нажмите кнопку «Выбрать». Если файл выбран, то на кнопке отображается название выбранного файла. Формат загружаемого файла описан в п. [5.1.6](#). Если нажата кнопка , то в качестве шаблона для SMS используется шаблон уведомлений, и кнопка выбора шаблона для SMS недоступна.
- «Рассылать по расписанию (чч:мм через `,')`» – включение принудительной отправки маржин-коллов по расписанию. Расписание задаётся в поле, расположенном ниже, перечислением через запятую моментов времени в формате <ЧЧ:ММ>.
- «Шаблон заголовка e-mail» – заголовок сообщения при отправке уведомления по электронной почте. По умолчанию используется шаблон, заданный на странице «Рассылка по e-mail».

6.1.3 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.

6.1.4 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».
- «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».
- «Отправлять SMS» * – включение рассылки оповещений через SMS (требует 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.

6.1.5 Журнал отправки оповещений

- «Вести журнал отправки оповещений в БД» – при включенном признаке информация об отправленных 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 имени 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 отправленных оповещений см. в п. [7.7](#).



6.2 Перенос позиций

Вкладка «Перенос позиций» содержит общие параметры переноса позиций клиента на фондовом рынке:

- «Переносить позиции на фондовом рынке» – включение возможности переноса позиций на фондовом рынке. Если флажок снят, то настройки на данной странице недоступны.
- «Переносить клиентов»:
 - «Брать список кодов клиентов из файла» – файл со списком клиентов, по которым производится перенос позиций. Формат файла описан в п. [7.3](#).
 - «Включить запрет на перенос длинных позиций» – исключить клиентов, список которых задан настройкой [ExcludeRollOverForLong](#) в файле переноса позиций, из заявок на перенос длинных позиций. Флажок доступен при установленном флажке «Брать список кодов клиентов из файла»
 - «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.
- «Переносить позиции»:



- «Разрешить одновременный перенос длинных и коротких позиций» – включение допустимости одновременного переноса коротких и длинных позиций. По умолчанию флажок снят.
- «Переносить длинные позиции только по маржинальным инструментам» – при включенном признаке все немаржинальные инструменты игнорируются и не участвуют в переносе длинных позиций. По умолчанию флажок снят.
- «Минимизировать количество сделок» – при включенном признаке сначала переносятся позиции по инструментам с наибольшей оценкой стоимости. По умолчанию флажок снят.
- «Раздельный учёт денежных позиций» – задание режима учёта денежных позиций. При включенной настройке все денежные позиции учитываются раздельно и перенос производится по каждой имеющейся отрицательной денежной позиции (даже при наличии положительных денежных позиций). При выключенной настройке все денежные позиции суммируются и переносятся получившаяся величина. Кроме того, при включенной настройке перенос денежных позиций производится только инструментами, номинированными в той же валюте, что и переносимая позиция. По умолчанию настройка включена.
- «Списывать со счета донора средства в валюте ... по коду позиции...» – задание параметров списания денежных средств со счета клиента-донора при переносе позиций. Настройка позволяет задать код валюты и код позиции. По умолчанию значение валюты – «SUR», кода позиции – «EQT».V».
- «Проверять достаточность средств в случае единственного донора» – включение проверки достаточности средств при указании только одного клиента-донора.
- «Клиенты-доноры по умолчанию» – задание списка клиентов-доноров:
 - «Из списка» (по умолчанию) – выбор клиента (из выпадающего списка) или нескольких клиентов (с помощью кнопки «...»).
 - «Из файла» – выбор файла со списком клиентов-доноров нажатием кнопки «...». Формат файла описан в п. [7.5](#).
- «Настройки модифицированного РЕПО» учитывают особенности подачи заявок на этом классе инструментов, 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 инструментам 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 каждому инструменту, имеющему отрицательный остаток, даже если его оценка меньше 1 рубля; при выключенном признаке заявки РЕПО формируются только если отрицательная позиция по данному инструменту имеет оценку свыше 1 рубля.



6.2.1 Параметры переноса

Вкладка «Параметры переноса» содержит настройки расчёта параметров заявок на перенос позиций:

Настройки клиентского места

Параметры переноса

	Длинные	Короткие
Ставка возмещения, %	3,00	3,00
Ставка РЕПО, %	1,0000	1,0000
Доп. комиссия за сделку	100,00	100,00
Макс. объем сделки	50000	

☐ Загружать ставки РЕПО из файла

☐ Суммировать объемы длинных и коротких позиций для расчета ставки РЕПО

Индивидуальные настройки переноса позиций по кодам клиентов

	Код клиента	Ставка, % (длин)	Срок (длин)	Ставка, % (кор)	Срок (кор)
1	E7/108	5,0000	10	3,0000	2

Добавить Редакт. Убрать Очистить ☐ Автовыбор знака ставки РЕПО

Справка OK Отмена

- «Параметры переноса» – значения по умолчанию для параметров подачи заявок на перенос длинных и коротких позиций:
 - «Ставка возмещения, %» – значение ставки возмещения, в процентах;
 - «Ставка РЕПО, %» – значение ставки, в процентах;
 - «Доп. комиссия за сделку» – размер дополнительной комиссии на перенос позиций по сделкам РПС / РЕПО.
- Величина дополнительной комиссии не списывается Сервером QUIK. Происходит только резервирование средств под эту комиссию.**
- «Макс. 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. Для коротких позиций настройка отсутствует.
- «Загружать ставки РЕПО из файла» – 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. [7.6](#).



- «Суммировать объемы 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) производится суммирование объёмов всех заявок на перенос длинных и коротких позиций. Ставка РЕПО по найденному суммарному обороту определяется по шкале ставок для длинных позиций (если шкала для длинных позиций в шаблоне отсутствует, то используется шкала для коротких позиций). Описание формата файла с шаблонами ставок см. в п. [7.6](#).
- «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:

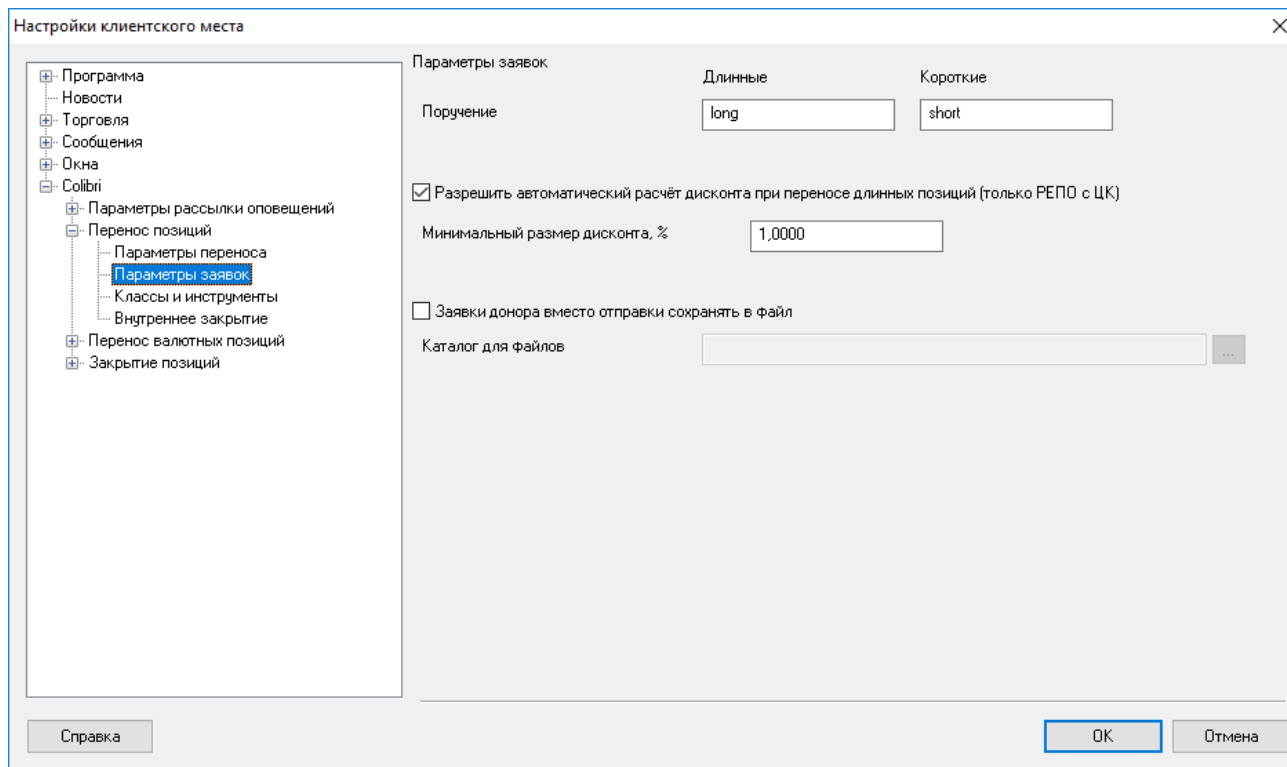
Название	Назначение
Код клиента	Код клиента
Ставка, % (длин)	Ставка РЕПО для длинных позиций, в процентах
Срок (длин)	Срок РЕПО для длинных позиций
Ставка, % (кор)	Ставка РЕПО для коротких позиций, в процентах
Срок (кор)	Срок РЕПО для коротких позиций

- «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.

6.2.2 Параметры заявок

Вкладка «Параметры заявок» содержит параметры поручения и настройки сохранения заявок для переноса позиций:





- «Параметры заявок»:
 - «Поручение» – 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;
- «Разрешить автоматический расчёт дисконта при переносе длинных позиций (только РЕПО с ЦК)» – автоматический подбор максимально возможного дисконта из тех, что обеспечивают закрытие длинных позиций при использовании режима РЕПО с ЦК. При этом для коротких позиций используется дисконт, заданный пользователем, либо полученный от биржи. По умолчанию флажок снят.
 - «Минимальный размер дисконта» – минимальный допустимый размер дисконта (допускаются как положительные, так и отрицательные числа).
- «Заявки донора вместо отправки сохранять в файл» – признак сохранения заявок донора в файл вместо отправки в торговую систему. По умолчанию флажок снят.
 - «Каталог для файлов» – выбор каталога для файлов с заявками донора.

6.2.3 Классы и инструменты

Вкладка «Классы и инструменты» содержит настройки списков классов и инструментов для переноса позиций:

- «Классы инструментов для переноса позиций» – задание списка классов, по которым возможен перенос позиций;



- «Переносить длинные позиции с использованием следующего порядка инструментов» – позволяет задать для кода клиента последовательность перебора инструментов, позиции по которым используются для подготовки заявок.
- «Ограничить перенос коротких позиций тем же списком» – если флажок установлен, то при переносе коротких позиций пропускаются все инструменты, отсутствующие в списке инструментов для переноса длинных позиций (см. выше), даже если по ним имеется отрицательная позиция. По умолчанию флажок снят.
- «Разрешить перенос длинных позиций с использованием прочих инструментов» – если флажок установлен, то при переносе длинных позиций после использования заданного списка инструментов выполняется перенос позиций по прочим инструментам. Если флажок снят, перенос ограничивается только инструментами, входящими в список. По умолчанию флажок установлен.

Если для клиента список инструментов не задан, а также не задан список для клиентов по умолчанию, то считается, что ограничения по инструментам отсутствуют, независимо от положения флажка.

6.2.4 Внутреннее закрытие

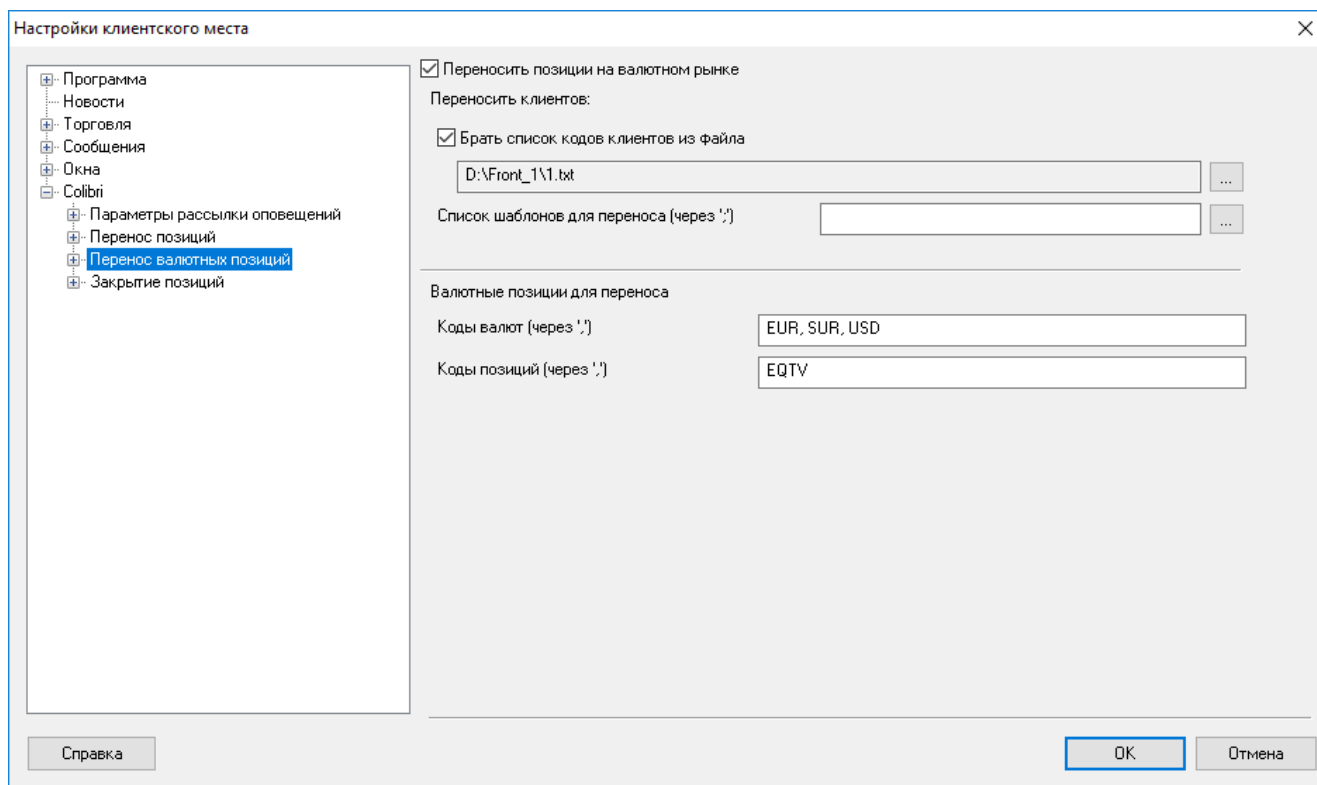
Вкладка «Внутреннее закрытие» содержит настройки внутреннего закрытия позиций при переносе:

- «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 Перенос валютных позиций

Вкладка «Перенос валютных позиций» содержит параметры переноса позиций клиента на валютном рынке:





- «Переносить позиции на валютном рынке» – включение возможности переноса позиций на валютном рынке. Если флажок снят, то настройки на данной странице недоступны, и пункт «Перенос валютных позиций...» в меню **Расширения / Colibri** отсутствует. По умолчанию флажок снят.
- «Переносить клиентов»:
 - «Брать список кодов клиентов из файла» – файл со списком клиентов, по которым производится перенос позиций. Формат файла описан в п. [7.3](#).
 - «Список шаблонов для переноса (через `;`)'» – список шаблонов (размеров плеча) через разделитель «;». Перенос позиций производится по клиентам, у которых задано плечо из списка. Для настройки списка шаблонов нажмите на кнопку «...» и в открывшемся окне введите значения размеров плеча через разделитель «;».

При выборе клиентов для переноса валютных позиций используется пересечение множеств клиентов, заданных в файле (если файл настроен) и имеющих шаблон из заданного списка шаблонов (если этот список задан).

- «Валютные позиции для переноса»:
 - «Коды валют (через `;`)'» – список кодов валют через запятую, позиции по которым должны переноситься. Значение по умолчанию: «EUR, USD».
 - «Коды позиций (через `;`)'» – список допустимых кодов позиций через запятую. Значение по умолчанию: «EQTV».



6.3.1 Параметры переноса

Вкладка «Параметры переноса» содержит настройки расчёта параметров заявок на перенос позиций:

Настройки клиентского места

Параметры переноса

☒ Использовать двухшаговую схему

☐ Сначала переносить за счёт требований, которые будут исполнены в клиринг

Ставка, %: 6,00 (Длинные), 3,00 (Короткие)

Поручение: long (Длинные), short (Короткие)

Партнёр: MB0099800000

Индивидуальные настройки переноса позиций по кодам клиентов

Код клиента	Ставка, % (дли)	Ставка, % (кор)	Ставка, % (ког)
1 E7/108	5,00	2,00	

Добавить Редакт. Убрать Очистить ☐ Автовыбор знака ставки

Справка OK Отмена

- «Использовать двухшаговую схему» – признак использования схемы переноса позиций сделками своп с использованием двух различных инструментов.
- «Сначала переносить за счёт требований, которые будут исполнены в клиринг» – в первую очередь переносить валютную позицию за счёт имеющихся требований по другим валютам. Когда требований по другим валютам становится недостаточно, перенос осуществляется за счёт фактически имеющихся остатков по другим валютам, значение которых отображается в поле «Текущий лимит» позиции со сроком расчетов T0. По умолчанию флажок снят.
- Значения по умолчанию для параметров подачи заявок на перенос длинных и коротких валютных позиций *:
 - «Ставка, %» – ставка кредитования, в процентах годовых.
 - «Поручение» – текстовый комментарий, предоставляемый на всех заявках на перенос валютных позиций, отправленных в торговую систему.
 - «Партнёр» – идентификатор участника торгов, являющегося контрагентом по сделке своп.

Если признак «Использовать двухшаговую схему» выключен, то настройки для длинных позиций недоступны. Если признак «Использовать двухшаговую схему» включен, то настройки для длинных и коротких позиций обязательны для заполнения.

! (*)



Короткая позиция – позиция, для переноса которой своп-инструмент продаётся (т.е. в первой части сделки валюта своп-инструмента покупается, а во второй части сделки – продается).

Длинная позиция – позиция, для переноса которой своп-инструмент покупается (т.е. в первой части сделки валюта своп-инструмента продается, а во второй части сделки – покупается).

- «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 кредитования для длинных позиций, в процентах. Не заполняется при выключенном признаке «Использовать двухшаговую схему»
Ставка,% (кор)	Ставка кредитования для коротких позиций, в процентах

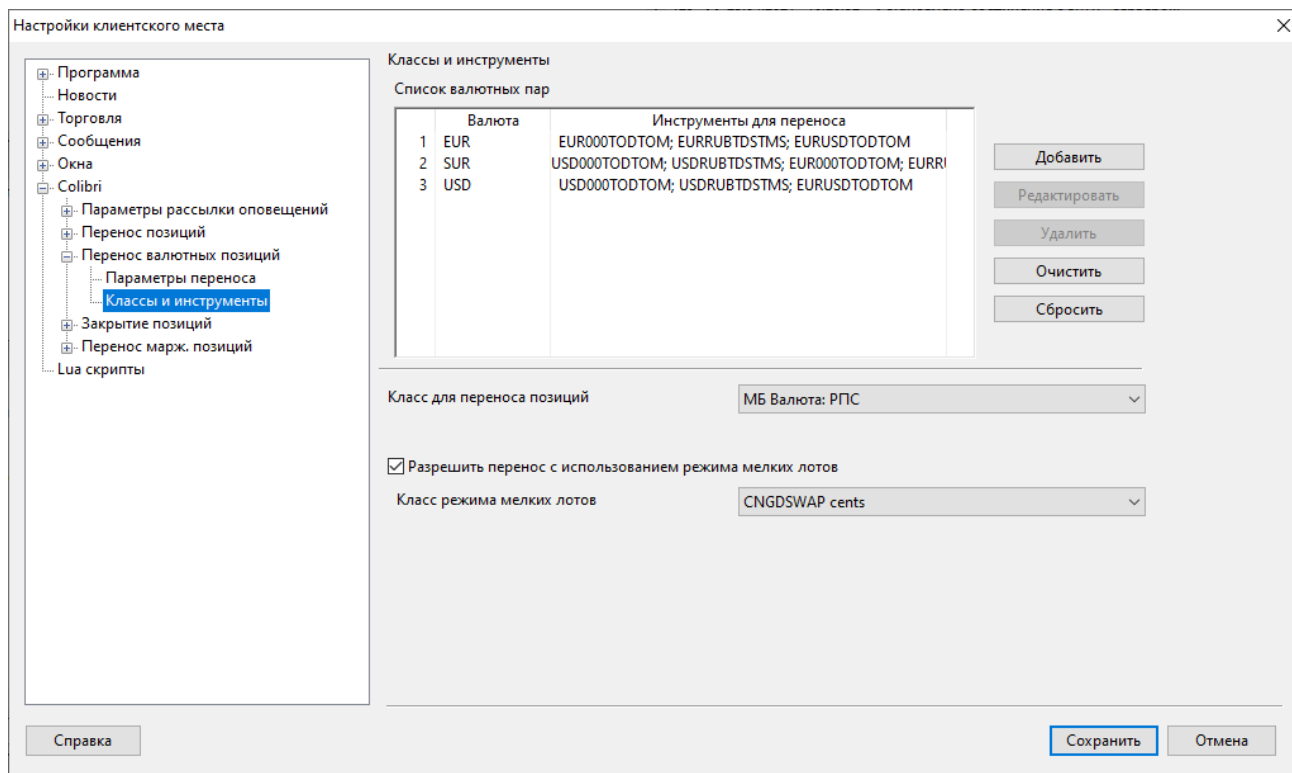
- «Добавить» – добавление настроек для нового кода клиента;
- «Редакт.» – редактирование настроек для выбранного кода клиента;
- «Убрать» – удаление выбранного кода клиента из списка;
- «Очистить» – удаление всех кодов клиентов из списка.

- «Автовыбор знака ставки» – если флажок установлен, то ставка кредитования 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.



6.3.2 Классы и инструменты

Вкладка «Классы и инструменты» содержит настройки списков классов и инструментов для переноса позиций:



- «Список валютных пар» – в таблице отображается порядок использования валютных пар для переноса позиций по каждой из имеющихся валют. По умолчанию используются следующие инструменты:

Валюта	Инструменты для переноса
EUR	EUR_TODTOM, EURUSDTODTOM
SUR	USD_TODTOM, EUR000TODTOM
USD	USD_TODTOM, EURUSDTODTOM

Для записей таблицы доступны следующие функции:

- «Добавить» – открытие диалога ввода валютных пар:



- «Код валюты» – код валюты, для которой переносятся позиции.
- «Коды инструментов для переноса позиций» – коды инструментов (валютных свопов) для переноса:
 - «Основной» *;
 - «Дополнительный» – поле активно, если на вкладке [«Параметры переноса»](#) установлен флажок «Использовать двухшаговую схему».
- «мелкие лоты» * – инструменты, торгуемые в классе мелких лотов, для переноса с использованием режима мелких лотов. Поле активно, если включен флажок «Разрешить перенос с использованием режима мелких лотов».

(*) В поле «мелкие лоты» недопустимо указание инструмента основного класса и наоборот. Также не допускается указание инструментов основного класса и класса мелких лотов с разными сроками расчетов.

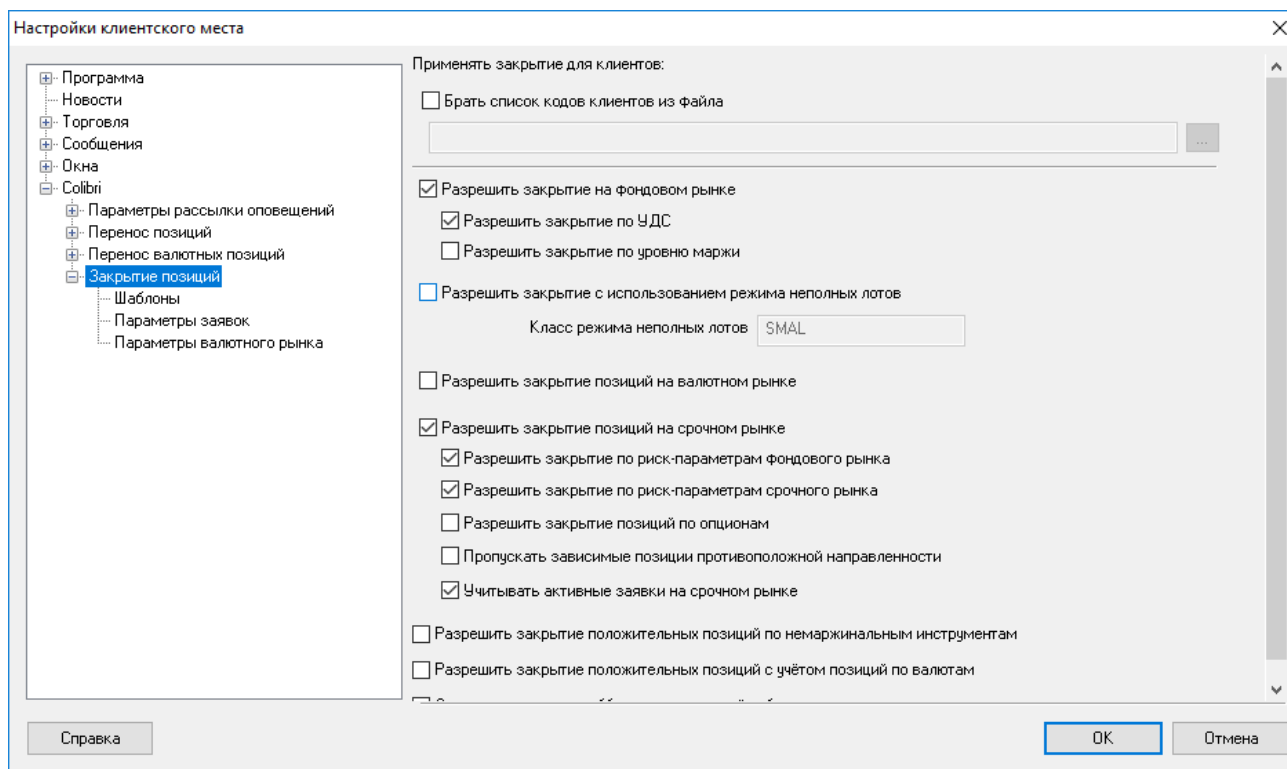
- «Редактировать» – изменение выделенной строки с настроенными валютными парами;
 - «Удалить» – удаление выделенной строки с настроенными валютными парами;
 - «Очистить» – удаление всех имеющихся в таблице строк;
 - «Сбросить» – возврат к значениям, установленным по умолчанию.
- «Класс для переноса позиций» – класс, используемый по умолчанию для переноса позиций. По умолчанию выбран класс с кодом CNGD.
 - «Разрешить перенос с использованием режима мелких лотов» – при установленном флажке сначала выполняется перенос позиций при помощи инструментов основного класса переноса позиций, а затем оставшаяся часть позиции переносится с помощью инструмента, торгуемого в классе мелких лотов. По умолчанию флажок снят.
- «Класс режима мелких лотов» – класс для переноса позиций в режиме мелких лотов. Параметр доступен при включенном флажке «Разрешить перенос с использованием режима мелких лотов» и обязателен к заполнению. По умолчанию выбран класс с кодом CNGD_SU.

Если режим мелких лотов применяется без использования двухшаговой схемы, то для валют, по которым планируется перенос, следует указать инструменты основного класса и класса мелких лотов.



6.4 Заккрытие позиций

Вкладка «Заккрытие позиций» содержит общие параметры закрытия позиций клиента:



- «Применять закрытие для клиентов» – настройка списка клиентов, по которому производится закрытие позиций:
 - «Брать список кодов клиентов из файла» – файл со списком клиентов, по которым производится закрытие позиций. Формат файла описан в п. 7.3.
- «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» – при установленном флажке доступны настройки закрытия позиций на фондовом рынке:
 - «Разрешить закрытие по УДС» * – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по УДС. По умолчанию флажок установлен;
 - «Разрешить закрытие по уровню маржи» * – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по уровню маржи. По умолчанию флажок снят;

(*) Обязательно должен быть установлен хотя бы один из флажков.
- «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».



- «Разрешить закрытие позиций на валютном рынке» – при установленном флажке разрешено закрытие валютных позиций. Применяется при ведении денежных позиций в разрезе валют для клиентов, использующих схему кредитования «по дисконтам» (клиенты типов «МД» и «МД+»). По умолчанию флажок снят.
- «Разрешить закрытие позиций на срочном рынке» – при установленном флажке доступны настройки закрытия позиций на срочном рынке:

- «Разрешить закрытие по риск-параметрам фондового рынка» ** – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по риск-параметрам фондового рынка. По умолчанию флажок снят;
- «Разрешить закрытие по риск-параметрам срочного рынка» ** – при установленном флажке разрешено закрытие позиций по риск-параметрам срочного рынка. По умолчанию флажок снят.

() Обязательно должен быть установлен хотя бы один из флажков.**

- «Разрешить закрытие позиций по опционам» – при установленном флажке разрешено закрытие позиций на срочном рынке по опционным позициям. По умолчанию флажок снят.
- «Пропускать зависимые позиции противоположной направленности» – при установленном флажке для закрытия позиций не используются позиции на срочном рынке, связанные с базовым активом, если по нему имеются позиции с противоположным риском. По умолчанию флажок снят.
- «Учитывать активные заявки на срочном рынке» – при установленном флажке при закрытии позиций учитываются активные заявки по инструментам срочного рынка. По умолчанию флажок установлен.
- «Разрешить закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам» – при установленном флажке разрешено закрытие положительных позиций по немаржинальным инструментам. По умолчанию флажок снят.
- «Разрешить закрытие положительных позиций с учётом позиций по валютам» – если флажок установлен, то при закрытии положительных позиций на фондовом рынке заявки формируются на объём, достаточный для закрытия отрицательной позиции по валюте, в которой торгуется инструмент. По умолчанию флажок снят.
- «Закрывать позицию субброкера из позиций субклиента» - при установленном флажке позиции субброкеров закрываются с использованием средств их субклиентов. При этом используются средства только тех субклиентов, коды которых выбраны для закрытия позиций. При недостатке средств субклиентов используются средства с собственных позиций субброкера.

Флажок доступен, если установлен хотя бы один из флажков «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» и «Разрешить закрытие позиций на валютном рынке». По умолчанию флажок снят.



6.4.1 Шаблоны

Вкладка «Шаблоны» содержит настройки правил закрытия позиций:

- «Фильтр шаблонов» – фильтр по наименованию шаблона или коду клиента, используемый для быстрого поиска информации в таблице. Правила закрытия позиций настраиваются для каждого шаблона или кода клиента в отдельном диалоге. Список правил представлен в виде таблицы. В столбцах таблицы отображаются следующие параметры:

Поле	Значение
Наименование	Наименование шаблона или код клиента
Тип	Тип шаблона (кода клиента). Возможные значения: – «Д» – фондовый рынок (закрытие по УДС); – «М» – фондовый рынок (закрытие по уровню маржи); – «С» – срочный рынок (закрытие на срочном рынке).
Шаблон	– «Да» – шаблон; – «Нет» – индивидуальная настройка
Риск-парам.	Для фондового рынка: – «УДС» – для схемы «По УДС»; – «Уровень маржи» – для схемы «По уровню маржи». Для срочного рынка: – <риск-параметр, выбранный в настройках>
Целевое значение	Для типа закрытия «По УДС» и при выбранном режиме «До заданного значения УДС»: – <значение УДС>. Для типа закрытия «На срочном рынке»: – <риск-параметр срочного рынка>
КПУР	Значение УДС, которое должно быть достигнуто в результате закрытия позиций клиентов с повышенным уровнем риска («КПУР»). Если этот параметр не задан, то для клиентов типа «КПУР» используется значение, заданное в параметре «Целевое значение». Заполняется для типа закрытия «По УДС» и при выбранном режиме «До заданного значения УДС»
Резерв, %	Требуемая величина резерва (процент, на который должна быть превышена начальная маржа). Заполняется только для фондового рынка (закрытие позиций по УДС)
Ур. Маржи, %	Требуемый уровень маржи. Заполняется только для фондового рынка (закрытие позиций по уровню маржи)
Квал. клиенты, %	Требуемый уровень маржи для квалифицированных клиентов. Заполняется только для фондового рынка (закрытие позиций по уровню маржи)
Порядок закр.	Порядок закрытия позиций
Порядок INSTR.	Порядок инструментов



- «Добавить» – добавление нового шаблона настроек.
- «Удалить» – удаление выбранного шаблона настроек из списка.
- «Изменить» – редактирование настроек выбранного шаблона.
- «Сделать основным» – установка выбранного шаблона основным (используемым по умолчанию) для клиентов соответствующего типа. Недоступно для индивидуальных настроек на код клиента.

Для каждого типа шаблона доступен только один шаблон с признаком «Основной». При выборе шаблона в качестве основного с предыдущего основного шаблона этого типа признак «Основной» снимается.

Правила закрытия позиций для всех клиентов по умолчанию отображаются первыми строками в списке – с признаком «Основной». Количество правил, отображаемых по умолчанию, зависит от типа закрытия позиций, выбранного в настройках («По УДС», «По уровню маржи», «На срочном рынке»). Строки не могут быть удалены из таблицы, но доступны для редактирования. При использовании «Фильтра шаблонов» (вне зависимости от его значения) строка «Все клиенты» не отображается в таблице.

Окно «Редактирование правила закрытия позиций»

Редактирование правила закрытия позиций

Тип настроек

☒ Шаблон ☐ Индивидуальная настройка

Наименование: Все клиенты

Тип закрытия

☒ По УДС ☐ По уровню маржи ☐ На срочном рынке

Режим: До заданного значения УДС

Целевое значение: 2

Повышенный уровень риска: 1

☐ При наличии единой позиции применять к позициям срочного рынка

☐ Применять при отсутствии спот-позиций

☐ Дополнительно использовать условие закрытия на срочном рынке

Порядок закрытия: Все

Режим закрытия позиций

☒ Минимальный оборот ☐ Пропорционально позиции ☐ Заданный порядок инструментов

(0)

OK Отмена

Окно содержит следующие параметры:

- «Тип настроек» – выбор режима задания настроек:
 - «Шаблон» (по умолчанию);



- «Индивидуальная настройка».

Недоступно для изменения, если форма открыта в режиме редактирования.

- «Наименование» – уникальное наименование шаблона. Значение по умолчанию: «Все клиенты». Поле доступно только в режиме задания настроек шаблона.
- «Код клиента» – уникальный код клиента, для которого задаются настройки. Поле доступно в режиме задания индивидуальных настроек для кода клиента.
- «Тип закрытия» – признак используемого типа закрытия позиций:
 - «По УДС» – закрытие по УДС. Доступен, если включены флажки «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» и «Разрешить закрытие по УДС», либо флажок «Разрешить закрытие позиций на валютном рынке», либо флажок «Разрешить закрытие позиций на срочном рынке» на вкладке «Закрытие позиций»;
 - «По уровню маржи» – закрытие по уровню маржи. Доступен, если включены флажки «Разрешить закрытие позиций на фондовом рынке» и «Разрешить закрытие по уровню маржи» на вкладке «Закрытие позиций»;
 - «На срочном рынке» – закрытие позиций на срочном рынке. Доступен, если включены флажки «Разрешить закрытие позиций на срочном рынке» и «Разрешить закрытие по риск-параметрам срочного рынка» на вкладке «Закрытие позиций».
- «Режим» – режим закрытия позиций. Возможные значения:
 - «До нормального статуса» (по умолчанию);
 - «До заданного значения УДС» – позиции закрываются до достижения значения УДС, указанного в поле «Целевое значение».

Параметр доступен при выборе типа закрытия «По УДС».

- «Риск-параметр» – выбор риск-параметра срочного рынка из списка доступных. Возможные значения:
 - «Планируемые чистые позиции»;
 - «Текущие чистые позиции»;
 - «Текущая задолженность на срочном рынке»;
 - «Достаточность средств»;
 - «Коэффициент ликвидности ГО»;
 - «Ожидаемый коэффициент ликвидности ГО».

Параметр доступен при выборе типа закрытия «По срочному рынку».

- «Резерв, %» – процент, на который должна быть превышена начальная маржа. Положительное значение. Поле доступно при выборе типа закрытия «По УДС» в режиме «До нормального статуса». Обязательно для заполнения.
- «Уровень маржи, %» – уровень маржи в процентах. Положительное значение с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Поле доступно при выборе типа закрытия «По уровню маржи».



- «Целевое значение» – значение выбранного риск-параметра или УДС, которое должно быть достигнуто в результате закрытия позиций. Положительное значение с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Поле доступно для типа закрытия «По УДС» и выбранном режиме «До заданного значения УДС», а также для типа закрытия «На срочном рынке».
- «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 «По уровню маржи»;
 - в настройках Рабочего места QUIK (пункт меню **Система / Настройки / Основные настройки...**, раздел «Торговля» / «Клиентский портфель») установлен флажок «Учитывать признак квалифицированности».
- «Повышенный уровень риска» – значение УДС, которое должно быть достигнуто в результате закрытия позиций клиентов с повышенным уровнем риска («КПУР»). Поле доступно для типа закрытия «По УДС» при выбранном режиме «До заданного значения УДС».
- «При наличии единой позиции применять к позициям срочного рынка» – при наличии ЕДП для закрытия позиций на срочном рынке используется тип закрытия «По УДС». Если настройка выключена, то позиции клиента на фондовом и валютном рынках закрываются отдельно от позиций на срочном рынке.
 Флажок доступен при выборе типа закрытия «По УДС», если включен флажок «Разрешить закрытие по риск-параметрам фондового рынка» на вкладке «Закрытие позиций» в настройках Рабочего места. При включенном флажке доступны следующие признаки:
 - «Применять при отсутствии спот-позиций» – при включенном признаке шаблон применяется при закрытии позиций по всем клиентам (без ЕДП со спот-позицией, с ЕДП без спот-позиции, с ЕДП со спот-позицией).
 Если признак выключен, то шаблон применяется при наличии у клиента ненулевой спот-позиции (без ЕДП со спот-позицией, с ЕДП со спот-позицией);
 - «Дополнительно использовать условие закрытия на срочном рынке» – при закрытии позиций для клиентов с ЕДП ко всем позициям (в том числе к позициям срочного рынка) применяется шаблон «по УДС», затем применяется шаблон «срочный рынок», из которого учитывается только риск-параметр и его целевое значение (остальные параметры закрытия остаются из шаблона «по УДС»).
- «Порядок закрытия» – порядок закрытия позиций. Возможные значения:
 - «Сначала длинные»;
 - «Сначала короткие»;
 - «Все» (по умолчанию).
- «Режим закрытия позиции»:



- «Минимальный оборот» – признак закрытия позиций по всем инструментам сразу, с минимальным объёмом сделок, создаваемых при закрытии. Доступен для типа закрытия «По УДС».
- «Пропорционально позиции» – признак закрытия позиций по всем инструментам сразу пропорционально размерам позиций, по которым осуществляется закрытие (все позиции закрываются на одну и ту же долю). Доступен только для типов закрытия «По УДС» и «По уровню маржи». Недоступен при включенном флажке «Дополнительно использовать условие закрытия на срочном рынке» и в режиме «До заданного значения УДС».
- «Заданный порядок инструментов» – порядок создания заявок на закрытие. При выборе данного режима доступна кнопка «...», с помощью которой задаётся порядок инструментов. Слева от кнопки отображается список выбранных инструментов и их количество. Недоступно при включенном переключателе «Пропорционально позиции».

Окно «Инструменты для закрытия» содержит следующие поля:

- «Доступные / Выбранные» – выбор инструментов для закрытия и настройка их очередности. В скобках отображается количество доступных / выбранных инструментов. Список доступных инструментов отсортирован по алфавиту.

Если среди выбранных инструментов имеется хотя бы один, отсутствующий среди инструментов, полученных с сервера QUIK (за исключением кодов валют), то выдаётся предупреждение «По некоторым выбранным инструментам торговля не производится».

- «Показывать наименования инструментов» – если флажок установлен, то в списке отображаются краткие наименования инструментов, иначе – коды инструментов. По умолчанию флажок снят.
- «Отображать инструменты фондового рынка» – включение отображения инструментов фондового рынка в списке доступных инструментов. По умолчанию флажок установлен.
 - «Отображать валютные пары» – включение отображения валютных пар в списке доступных инструментов. Флажок доступен при установленном флажке «Отображать инструменты фондового рынка». По умолчанию флажок снят.
- «Отображать валюты» – включение отображения валюты в списке доступных инструментов. По умолчанию флажок установлен.
- «Отображать инструменты срочного рынка» – включение отображения инструментов срочного рынка в списке доступных инструментов. По умолчанию флажок установлен.
 - «Задавать через базовые активы» – если флажок установлен, то в качестве доступных инструментов отображаются их базовые активы (в квадратных скобках). По умолчанию флажок снят.
- «Актуализировать список на срочном рынке» – удаление из списка выбранных инструментов срочного рынка, которые не были получены с сервера, и добавление инструментов, по которым хотя бы у одного клиента



есть позиция. Действие признака не распространяется на инструменты срочного рынка, заданные через базовые активы.

- «Импорт из файла...» – файл в формате *.txt для загрузки списка инструментов. Формат загружаемого файла описан в п. [7.4](#).
- «Экспорт в файл...» – сохранения списка текущих инструментов в файл в формате *.txt. Формат файла описан в п. [7.4](#).

6.4.2 Параметры заявок

Вкладка «Параметры заявок» содержит настройки параметров заявок на закрытие позиций:

- «Защитный спред, %» – 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 указывается в процентах с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Значение по умолчанию: «0».
- «Защитный спред для неполных лотов, %» – дополнительное (опережающее) отклонение цены закрытия заявки от текущей рыночной цены при использовании режима неполных лотов. Цена закрытия увеличивается на указанное значение в заявках на покупку и уменьшается в заявках на продажу. Значение указывается в процентах с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. По умолчанию используется значение настройки «Защитный спред, %».
- «Поручение» – текст комментария в заявках на закрытие позиций. Может использоваться для идентификации заявок на закрытие позиций при интеграции с внутренними системами брокера. Максимальный размер: 20 символов.
- «Валюта основной денежной позиции» – основная валюта дисконтной схемы. Используется для расчётов по клиентам типов «МД» и «МД+» при наличии нескольких валют с нулевым дисконтом. Если настройка не задана (или задана валюта с ненулевым дисконтом), то для расчётов по клиентам типов «МД» и «МД+» используется первая из валют с нулевым дисконтом. При наличии единственной валюты с нулевым дисконтом она используется в качестве основной валюты дисконтной схемы, и данная настройка игнорируется. Значение по умолчанию: «SUR».

6.4.3 Параметры валютного рынка

Вкладка «Параметры валютного рынка» содержит параметры закрытия позиций клиента на валютном рынке:

- «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;
 - «Инструменты» – список кодов инструментов, которые используются для закрытия позиции (через запятую).



1. **Очередность использования инструментов для закрытия позиций по валюте определяется порядком перечисления инструментов в списке. При наличии нескольких инструментов по одной валютной паре с разными сроками расчётов первым необходимо указывать инструмент с более ранним сроком расчётов. Например, если для закрытия требуется использовать инструменты со сроками TOD и TOM, то инструмент со сроком TOD должен быть указан в списке перед аналогичным инструментом со сроком TOM.**
2. **Если для валюты не указан допустимый для закрытия позиции инструмент, то позиция по такой валюте не закрывается.**
3. **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	Инструменты
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» – список для выбора класса инструментов, на котором закрываются валютные позиции. По умолчанию выбран класс с кодом CETS.
- «Разрешить закрытие с использованием режима мелких лотов» – при установленном флажке сначала выполняется закрытие позиций при помощи инструментов основного класса закрытия позиций, а затем оставшаяся часть позиции закрывается с помощью инструмента, торгуемого в классе мелких лотов. По умолчанию флажок снят.
 - «Класс режима мелких лотов» – класс для закрытия позиций в режиме мелких лотов. Параметр доступен при включенном флажке «Разрешить закрытие с использованием режима мелких лотов» и обязателен к заполнению. По умолчанию выбран класс с кодом CETS_SU.



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

Настройка IncludeClients имеет приоритет над настройкой ExcludeClients.

- ExcludeRollOverForLong – список кодов клиентов (через запятую), по которым не должен выполняться перенос длинных позиций.

Формат:

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

7.4 Формат списка инструментов для закрытия позиций

В файле задаётся список кодов инструментов и кодов валют фондового рынка, которые могут использоваться для закрытия позиций. Инструменты в списке перечисляются через запятую и/или перевод строки, пробелы вокруг разделителя игнорируются.

Пример:

```
LKOH, SBER, AFLT
```



7.5 Формата файла со списком доноров клиента

Файл имеет текстовый формат. В секции [Donors] настройте параметр:

- IncludeClients – список клиентов-доноров, используемых при переносе позиций («белый список»).

Формат:

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

7.6 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 добавить в файл строку вида:

```
0=<Ставка РЕПО>
```

Изменение настроек файла применяется автоматически.



7.7 Формат таблицы базы данных для сохранения отправленных оповещений

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

(*) Указано название таблицы по умолчанию. Имя таблицы может быть изменено пользователем (см. п. [6.1.5](#)).

Поле	Тип данных	Описание
ID	int, autoincrement	Номер записи в таблице. Поле заполняется автоматически
MCType	int, NULL	Тип оповещения (Margin call). Возможные значения: «NULL или 0» – обычные оповещения на фондовом рынке (старая схема маржинального кредитования); «1» – оповещение на срочном рынке типа «Отрицательный остаток свободных средств»; «2» – оповещение на срочном рынке типа «Уровень достаточности средств»; «3» – оповещение на срочном рынке типа «Коэффициент ликвидности ГО»; «4» – оповещение на срочном рынке типа «Ожидаемый коэффициент ликвидности ГО»; «5» – оповещение на срочном рынке типа «Композитный критерий»; «6» – оповещение на срочном рынке по произвольному риск-параметру; «7» – оповещение на срочном рынке по уровню маржи; «8» – оповещения (новая схема маржинального кредитования – «по дисконтам»); 9 – оповещение на срочном рынке типа «Уровень достаточности средств (под открытые позиции)»
MCType	int	Подтип оповещения, только для маржин-коллов типа «по дисконтам» (MCType=8) и «по уровню маржи» (MCType=0, MCType=7). Возможные значения: «1» – уровень ограничения; «2» – уровень требования; «3» – уровень закрытия Выбранный уровень соответствует тому типу оповещения, который отсылается
TDate	integer	Дата отправки оповещения в формате <ГГГГММДД>
MCTime	integer	Время отправки оповещения в формате <ЧЧММСС>
MCLevel	decimal(19,4)	Уровень маржи, который был пробит. Возможные значения: - Для оповещений типа «0»: «0». - Для оповещений типа «1»: «0».



Поле	Тип данных	Описание
		– Для оповещений типа «2», «9»: значения параметров «Дост. средств» и «Дост. средств (ОткрПоз)», которые были превышены; – Для оповещений типа «3»: – «0» – при недопустимом значении Коэффициента ликвидности ГО; – «1» – при отрицательном значении полной суммы денежных остатков; – Для оповещений типа «4»: значение, указанное как граничное для коэффициента ликвидности ГО; – Для оповещений типа «5»: величина, указанная в настройках как условие оповещения для основного риск-параметра. Для риск-параметра «Стоимость портфеля» заполняется значением «0». – Для оповещений типа «6»: величина, указанная как граничное значение параметра; – Для оповещений типа «7»: граничный уровень маржи (при необходимости с учётом типа квалифицированности клиента); – Для оповещений типа «8»: «0»
Equity	decimal(19,4)	Стоимость портфеля
Margin	decimal(19,4)	Уровень отслеживаемого параметра в момент отсылки оповещения. Для оповещений типа «3»: параметр, который вызвал нарушение (с приоритетом коэффициента ликвидности ГО). – Для оповещений типа «5»: уровень отслеживаемого основного риск-параметра. Для риск-параметра «Стоимость портфеля» указывается значение начальной маржи.
CorrMargin	decimal(19,4)	Скорректированная маржа. Используется только для маржин-коллов типа «по дисконтам»
MinMargin	decimal(19,4)	– Для оповещений по стоимости портфеля (клиенты типов «МД» и «МД+»): минимальная маржа. – Для оповещений по уровню маржи (клиенты отличные от типов «МД» и «МД+»): уровень принудительного закрытия позиции для данного клиента
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)	Оценка стоимости инструментов в денежном выражении
MoneyValue	decimal(19,4)	Текущий остаток по деньгам
CCode	varchar(12)	Код клиента – для клиентов с единой денежной позицией. Торговый счёт на срочном рынке – для клиентов срочного рынка без единой денежной позиции
FirmID	varchar(12), NULL	Код фирмы
MsgText	varchar(255), NULL	Текст оповещения (фрагментами по 255 байт; остаток



Поле	Тип данных	Описание
MsgText2	varchar(255), NULL	игнорируется).
MsgText3	varchar(255), NULL	В некоторых базах данных поддерживаются поля большего размера. В этом случае сообщение разбивается на фрагменты в соответствии с размером этих полей
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
RCV1	decimal(19,4)	Величина параметра «НПП1» в момент отсылки маржин-колла
RCV2	decimal(19,4)	Величина параметра «НПП2» в момент отсылки маржин-колла

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

7.8 Определение статусов клиентов

Для клиентов типа «МД» и «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;
- «Заккрытие» – стоимость портфеля меньше минимальной маржи.

Для клиентов отличных от типа «МД» и «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;
- «Заккрытие» – уровень маржи меньше, чем уровень маржи принудительного закрытия.



7.9 Расчёт параметров переноса валютных позиций

Для пересчёта цены в ставку (и обратно) при переносе валютных позиций используются следующие формулы:

1. Расчёт цены по ставке:

$$P = P_0 \frac{R}{100} \left(\frac{T_{365}(D_1, D_2)}{365} + \frac{T_{366}(D_1, D_2)}{366} \right)$$

Значение округляется до точности цены инструмента.

2. Расчёт ставки по цене:

$$R = \frac{P}{P_0} \frac{100}{\left(\frac{T_{365}(D_1, D_2)}{365} + \frac{T_{366}(D_1, D_2)}{366} \right)}$$

Значение округляется до 2 знаков после десятичного разделителя.

Где:

- R – ставка (в процентах).
- P_0 – базовый курс инструмента (параметр «Баз.курс» Таблицы текущих торгов).
- P – цена относительно базового курса для переноса позиций (в валюте).
- D_1 – дата первой части своп-инструмента (параметр «Дата расч.1» Таблицы текущих торгов).
- D_2 – дата второй части своп-инструмента (параметр «Дата расч.» Таблицы текущих торгов).
- $T_{365}(D_1, D_2)$ – число дней из интервала $(D_1, D_2]$, попадающих на год с 365 днями.
- $T_{366}(D_1, D_2)$ – число дней из интервала $(D_1, D_2]$, попадающих на год с 366 днями.

