ARQA TECHNOLOGIES

Настройки Библиотеки расчета лимитов

Руководство по администрированию

Версия 10.0

quik

Содержание

1. Подготовка к работе 4
2. Особенности интерфейса 5
3. Перезагрузка настроек через QMonitor 6
4. Общие параметры 6
5. Другие параметры 32
6. Брокерская комиссия 36
7. Классы 47
8. Инструменты 59
9. Пользователи 73
10. Клиенты / Комиссия брокера 79
11. Клиенты / Замена кодов 103
12. Клиенты / Субброкеры 107
13. Клиенты / Настройки «плеча» 111
14. Клиенты / Шаблоны / По комиссии 138
15. Клиенты / Шаблоны / По «плечу» 154
16. Клиенты / Шаблоны / По ограничениям 176
17. Клиенты / Доп. теги расчетов 191
18. Учет операций срочного рынка 200
19. Валюты денежных позиций 205
20. Ограничения на … / Цены заявок 207
21. Ограничения на … / Корректировка лимитов 213
22. Ограничения на … / Использование «плеча» 214
23. Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования 218
24. Ограничения на … / Квалифицированные инвесторы 241
25. Ограничения на … / Доступные бумаги 247
26. Ограничения на … / По бумагам на счета 252
27. Ограничения на … / Минимальный размер клиентских средств 253

28.Ограничения на … / Объем заявок.....254
29.Ограничения на … / Типы заявок.....259
30.Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО.....261
31.Дополнительные ограничения.....265
32.Списки маржинальных бумаг.....267

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

1. Подготовка к работе

Для каждого дилера подключается своя копия библиотеки. Библиотек может быть несколько и в том случае, когда сервер QUIK одного дилера (фирмы) настроен на работу с несколькими торговыми площадками.

Для подключения библиотеки к серверу QUIK необходимо до запуска системы в файле quik.ini в директории, в которой установлен сервер, в секцию [dealer-library] добавить строчку вида:

```
<FirmID>=<path-to-dealer-library>
```

где **FirmID** – идентификатор дилера в торговой системе,

path-to-dealer-library – полный или относительный путь до файла с библиотекой.

Например, для ТС фондового рынка Московской Биржи FirmID имеет вид «NC<5-значный код>00000» и присваивается сотрудниками Московской Биржи. При этом первая буква означает принадлежность к региональной площадке («N» – Новосибирск, «M» – Москва и т.п.).

Для каждой копии библиотеки в той же директории, что и сама библиотека, может находиться ini-файл с тем же именем и расширением .ini. Из этого файла считываются различные настройки библиотеки. Если для разных FirmID была указана одна и та же библиотека, то для них будет использоваться один и тот же файл настроек.

После подключения описанным выше способом при очередном старте сервера необходимо проконтролировать корректность подключения. Для этого необходимо убедиться, что в файле «events.log» после запуска сервера появилась строка вида:

```
Dealer library module "D:\QUIK1\Server\DealLibTempModules\fda3e4ed-64ab-470b-99e6-bda74e635fa6.dll" with interface version 90200 loaded at address 0x0000000000400000.
```

В случае неудачной загрузки в том же файле будет содержаться сообщение об ошибке, например:

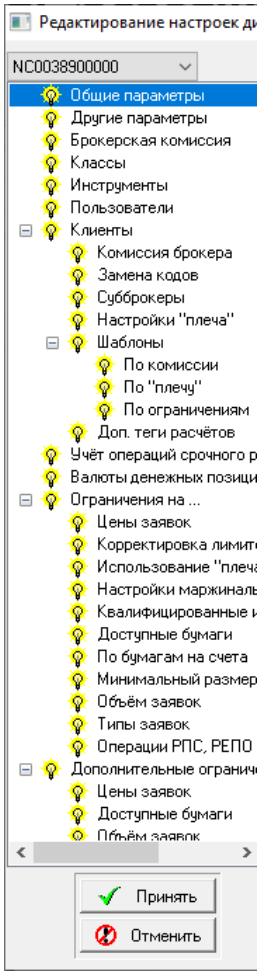
```
Error: Failed to start process: "Failed to initialize engine context: "Dealer library version is not supported""
```

После удачного подключения Дилерской библиотеки сервер QUIK вызывает ее функции для обезличенных сделок, заявок и транзакций пользователей, относящихся к данному дилеру.

2. Особенности интерфейса

Управление настройками Дилерской библиотеки осуществляется через пункт меню **Сервер QUIK / Библиотеки расчета лимитов** программы QUIK Administrator. При выборе пункта меню открывается окно «Библиотеки расчета лимитов» со списком библиотек с именами, соответствующими идентификаторам дилера в торговой системе (FirmID), заданным в секции [dealer-library] файла quik.ini. Если в настройках сервера QUIK задан только один идентификатор, то список не отображается. Для настройки контроля торговых операций выберите библиотеку и нажмите кнопку «Открыть». Для просмотра настроек без возможности редактирования нажмите кнопку «Открыть для чтения».

Интерфейс настроек библиотеки разделен на страницы, переключение между которыми осуществляется в окне слева. Каждая страница отмечена значком . Если значок перечеркнут, то отображение настроек на этой странице отключено на странице «Общие параметры». В правой части экрана отображаются параметры настройки каждой страницы.



Поле со списком, расположенное над списком страниц, предназначено для переключения между библиотеками.

Для выхода из настроек Дилерской библиотеки с сохранением изменений нажмите кнопку «Принять» в левом нижнем углу окна. Для выхода без сохранения нажмите «Отменить».

3. Перезагрузка настроек через QMonitor

Для перезагрузки настроек Библиотеки расчёта лимитов используются следующие команды QMonitor:

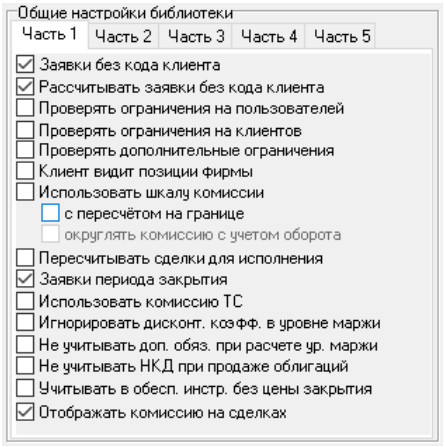
- **Actions / Reload dealer library** – перезагрузка всех настроек Библиотеки расчёта лимитов.
- **Actions / Reload dealer library softly** – «мягкая» перезагрузка ограниченного списка настроек Библиотеки расчёта лимитов, при которой изменения настроек не рассылаются на рабочие места пользователей QUIK, что позволяет уменьшить объём отправляемых данных и снизить загрузку сервера QUIK.
  Перезагружаются следующие настройки:
  - «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций»;
  - «Разрешить менеджеру закрытие позиций»;
  - «Торговые счета, запрещенные для клиентских операций»;
  - «Инструменты с ограничением доли в обеспечении»;
  - «Ограничение торговли опционами»;
  - «Клиенты с доступом к сложным инструментам»;
  - «Сложные инструменты»;
  - «Список инвесторов, которые являются квалифицированными» / «Список инвесторов, которые не являются квалифицированными»;
  - Настройки шаблонов «По ограничениям» (страница Клиенты / Шаблоны / По ограничениям).

4. Общие параметры

Страница «Общие параметры» управляет общими настройками библиотеки, которые распространяются на остальные настройки на других страницах как «по умолчанию» и определяют доступность расширенных параметров для редактирования.

4.1 Общие настройки библиотеки. Часть 1

Общие настройки разделены на вкладки «Часть 1» … «Часть 5». Значения параметров приведены в таблице.



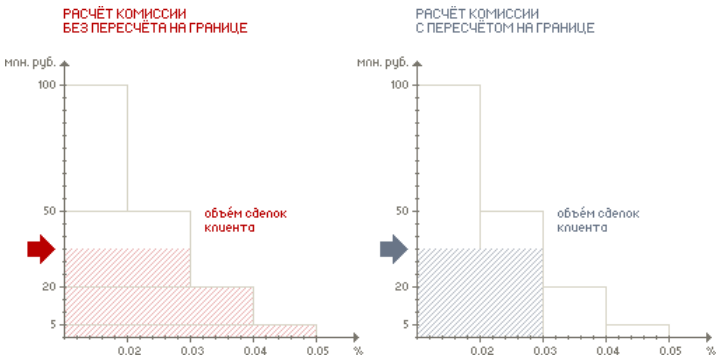
Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Заявки без кода клиента	Определяет возможность приема заявок с пустым кодом клиента. Если признак отключен, то заявки без указания кода клиента отвергаются сервером, независимо от полномочий пользователя, который ввел такую заявку. Для этого флажок «Проверять ограничения на пользователей» должен быть включен	Включен
Рассчитывать заявки без кода клиента	Включает обработку заявок с пустым кодом клиента по тем же правилам, как для заявок с указанным кодом клиента. Если признак включен, то по таким заявкам рассчитываются лимиты, выполняется проверка покупательной способности и прочих ограничений	Выключен
Проверять ограничения на пользователей	Определяет осуществление проверки дополнительных ограничений для пользователей, заданных на странице «Пользователи». Отключение данного параметра делает невозможным редактирование страницы «Пользователи» и подчиненных ей страниц	Выключен
Проверять ограничения на клиентов	Определяет осуществление проверки дополнительных ограничений для клиентов, заданных на странице «Клиенты». Отключение данного параметра и параметра «Использовать шкалу комиссии» делает невозможным редактирование страницы «Клиенты» и подчиненных ей страниц	Выключен
Проверять дополнительные ограничения	Включает проверку дополнительных ограничений (см. п. 31). Если настройка выключена, то проверка дополнительных ограничений не производится, независимо от состояния других настроек программы	Выключен
Клиент видит позиции фирмы	Определяет, может ли клиент фирмы видеть позиции фирмы по бумагам и деньгам	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Использовать шкалу комиссии	Включает механизм расчета комиссии брокера с использованием шкалы. Для использования шкалы при расчете брокерской комиссии необходимо включить признак и настроить параметры в секции «Базовые настройки комиссии» (см. п. 4.6), в которой следует указать проценты комиссии для всех клиентов по умолчанию для соответствующего дневного оборота	Выключен
_ с пересчетом на границе	Включает перерасчет значения комиссии при переходе границы между различными процентными ставками*. Если признак включен, то одно значение комиссии берется со всего дневного оборота. Значение процента комиссии определяется исходя из дневного оборота клиента и шкалы комиссии. Если признак выключен, то на каждом участке шкалы комиссии взимается свой процент комиссии	Выключен
_ округлять комиссию с учетом оборота	Включает корректный расчет комиссии в случаях сделок малого объема и при частичном исполнении заявки несколькими сделками меньшего объема. Если признак включен, комиссия брокера по шкале округляется на суммарный торговый объем клиентских операций за день. Если признак выключен, комиссия брокера по шкале округляется на фактический объем сделки	Выключен
Пересчитывать сделки для исполнения	Определяет пересчет позиций клиентов при подтверждении сделок для исполнения в режимах РПС и РЕПО. При выключенном флажке позиции клиентов при подтверждении заявок-отчетов не изменяются	Выключен
Заявки периода закрытия	Разрешает прием от клиентов заявок во время периода закрытия торговой сессии	Включен
Использовать комиссию ТС	Определяет размер комиссии торговой системы, подлежащий списанию с денежного лимита клиента при заключении сделки. При выключенном флажке размер комиссии ТС, подлежащей списанию, высчитывается сервером QUIK. При включенном флажке списывается комиссия, указанная биржей (поле «комиссия ТС» в Таблице сделок Рабочего места QUIK)	Выключен
Игнорировать дисконт. коэфф. в уровне маржи	Отключает использование коэффициентов оценки стоимости длинной и короткой позиции (см. п. 23, параметры Long и Short) при расчете уровня маржи	Выключен
Не учитывать доп. обяз. при расчете ур. маржи	Отключает учет сумм с лимитов по денежным средствам на тегах дополнительных обязательств (см. п. 17,	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	параметры «Теги обязательств») при расчете уровня маржи	
Не учитывать НКД при продаже облигаций	Разрешает не учитывать Накопленный купонный доход (НКД), возвращаемый продавцу при продаже облигаций, не увеличивая покупательную способность клиента на его денежном лимите при совершении сделки	Выключен
Учитывать в обеспечении инструменты без цены закрытия	Если настройка выключена, наличие цены закрытия является обязательным требованием к классу для использования его в оценке позиции по данной бумаге. Если настройка включена, то вступает в силу усовершенствованный алгоритм выбора класса для оценки позиций по бумагам, который позволяет для оценки позиций использовать классы, в которых определена цена последней сделки при неопределенной цене закрытия	Выключен
Отображать комиссию на сделках	Включает отображение в поле «Комиссия брокера» Таблицы сделок комиссии, удержанной с клиента: _ для сделок на фондовом и валютном рынках – отображается суммарная комиссия брокера и ТС; _ для сделок на срочном рынке – отображается комиссия ТС, а если она не используется, то комиссия брокера	Выключен

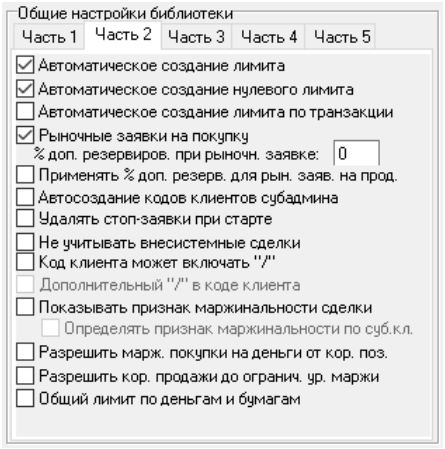
Комментарии к пересчету комиссии на границе:

1. **Условие «без пересчета на границе» означает, что при превышении клиентом граничного значения для суммарного объема активных заявок и сделок, величина комиссии по новой процентной ставке будет применяться только к сумме превышения.**
2. **Условие «с пересчетом на границе» означает, что в случае превышения граничного значения величина комиссионного вознаграждения по всем предыдущим сделкам и активным заявкам пересчитывается по новой процентной ставке.**



Например, при комиссии 0.2% с оборота до 100 000 р., 0.1% с оборота от 100 000 до 1 млн. р. И 0.05% с оборота более 1 млн. р. комиссия с оборота в 300 000 р. составит 300 000*0.1/100 = 300 р. если признак «с пересчетом на границе» включен и (100 000*0.2 + (300 000 – 100 000)*0.1) / 100 = 400 р. в противном случае.

4.2 Общие настройки библиотеки. Часть 2



В таблице приведены параметры, настраиваемые на вкладке «Часть 2».

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Автоматическое создание лимита	Включает автоматическое создание лимитов по бумагам немаржинальным клиентам по заявкам, введенным не с Рабочего места QUIK, а, например, с терминала Московской Биржи. Если признак включен, и лимит по бумаге клиенту не был задан, то он автоматически сформируется в размере, соответствующем количеству в заявке, и это количество сразу же заблокируется. Настройка не учитывается при использовании настройки «Вести позиции в календарных днях»	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Автоматическое создание нулевого лимита	Включает автоматическое создание нулевых лимитов при поступлении заявки, введенной не с Рабочего места QUIK. Если признак включен и лимит не был задан, то он автоматически сформируется (нулевой), а количество, необходимое для реализации заявки, сразу же заблокируется. Настройка не учитывается при использовании настройки «Вести позиции в календарных днях»	Выключен
Автоматическое создание лимита по транзакции	Включает автоматическое создание лимита по бумагам при выставлении заявки. Распространяется на клиентов с типом кредитования «По лимитам» и «На открытую позицию». Настройка не учитывается при использовании настройки «Вести позиции в календарных днях»	Выключен
* Рыночные заявки на покупку	Разрешает клиентам выставлять рыночные заявки на покупку. Чтобы разрешить пользователю выставление рыночных заявок, необходимо в настройках пользователя в программе QUIK Administrator на вкладке «Права по классам» для нужных классов включить признак «Рыночные заявки на покупку». При подаче рыночной заявки сервер QUIK резервирует в поле «Заблокировано» таблицы «Позиции по деньгам» Рабочего места QUIK необходимую сумму, расчет которой отличается в зависимости от периода торгов: _ Период открытия: используется цена закрытия, а при ее отсутствии — цена последней сделки. _ Основная торговая сессия: используются цены лучшего спроса и предложения, при их отсутствии — цена последней сделки, а при ее отсутствии — цена закрытия. _ Период заявок по цене аукциона закрытия: используется цена аукциона, при ее отсутствии — цена закрытия, а при ее отсутствии — цена последней сделки. Если используется настройка «Классы экспорта цен для оценки рыночных заявок», то цена	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	определяется в соответствии с описанным в ней порядком. При расчете суммы учитывается процент дополнительного резервирования под рыночные заявки. Если цену рыночной заявки определить не удалось, заявка отвергается. Данная настройка используется совместно с настройкой «Классы и инструменты, в которых допускается подача рыночных заявок на покупку»	
_ % доп. резервиров. при рыночн. заявке	Процент дополнительного резервирования при рыночной заявке. Данная настройка применяется при блокировке денежных средств для: _ рыночных заявок в основных режимах торгов; _ рыночных заявок в аукционах периодов открытия и закрытия Московской биржи (МБ); _ заявок в режимах крупных лотов МБ; _ заявок в режимах фиксинга и с использованием средневзвешенного курса на валютном рынке МБ. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «% доп. резервиров. при рыночн. заявке в разрезе классов»	Выключен
_ Применять % доп. резерв. для рын. заяв. на прод.	Включить учет процента дополнительного резервирования для рыночных заявок на продажу. При включенном признаке для рыночных заявок на продажу цена для расчета скорректированной маржи в МД-схеме определяется по формуле (с округлением в сторону уменьшения до ближайшего значения, кратного точности цены): Price * (100 - AdditionalReservationPercent)/100, где: _ AdditionalReservationPercent – процент дополнительного резервирования. _ Price – лучшая цена спроса для основного режима торгов или цена закрытия/цена последней сделки для периода открытия/закрытия соответственно.	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	Доп. процент резервирования будет применен для отдельной заявки только в момент ее выставления. Если порядок торгов предполагает отложенное исполнение рыночной заявки, то в дальнейшем она оценивается по цене последней сделки. Настройка действует для схем «По дисконтам» и «МД+»	
** Автосоздание кодов клиентов субадмина	Включает автоматическое создание кодов для клиентов субадминистратора. Если признак включен, то список клиентов субадминистратора может не задаваться явным образом на странице «Субброкеры», а формироваться автоматически по заданным правилам	Выключен
Удалять стоп-заявки при старте	Отменяет загрузку неисполненных стоп-заявок при старте сервера	Выключен
Не учитывать внесистемные сделки	Определяет учет внесистемных сделок в позициях клиентов. При включенном флажке операции в режимах РПС и РЕПО не влияют на позиции клиентов	Выключен
Код клиента может включать “/”	Разрешает использование символа «/» в кодах клиентов. Если признак включен, то либо весь комментарий к заявке расценивается как код клиента (если комментарий содержит менее двух символов «/»), либо за код клиента принимается подстрока от начала комментария до второго символа «/». Если признак выключен, то, когда комментарий содержит «/», за код клиента принимается подстрока от начала комментария до первого символа «/»	Выключен
Дополнительный “/” в коде клиента	Добавляет второй символ «/» в код клиента по следующему правилу: если код клиента содержит символ «/», то второй символ добавляется в окончание кода; если код не содержит символов «/», то в окончание кода добавляется два символа «/»	Выключен
Показывать признак маржинальности сделки	Включает отображение в Таблице сделок признака маржинальности сделки в поле «Тип сделки»	Выключен
_ Определять признак	При включенном флажке сделки субклиентов считаются маржинальными (в Таблице сделок они	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
маржинальности по субклиенту	имеют тип сделки – «Маржинальная»), если эта сделка является маржинальной для самого субклиента. Если флажок снят, то маржинальность сделки определяется из достаточности средств субброкера. Свойство доступно для изменения при включенном флажке «Показывать признак маржинальности сделки»	
Разрешить марж. покупки на деньги от кор. поз.	Разрешает использование средств, полученных от открытия коротких позиций, на открытие маржинальных длинных позиций. Настройка используется только для схемы кредитования клиентов «по плечу»	Выключен
Разрешить кор. продажи до огранич. ур. маржи	Разрешает открытие коротких позиций, если они не приводят к нарушению ограничительного уровня маржи. Настройка используется только для схемы кредитования клиентов «по плечу»	Выключен
Общий лимит по деньгам и бумагам	Распространяется на клиентов с типом кредитования «По лимитам». Для включения флажка должна быть отключена проверка операций шорт (см. п. 22. «Ограничения на использование плеча»). При включении данной настройки, все маржинальные операции в сумме (и покупка на заёмные деньги, и шорт) ограничиваются величиной установленного клиенту денежного лимита. Величина лимитов по бумагам перестает учитываться. При включении настройки, также появляются следующие отличия в отображении операций клиента: – маржинальные операции покупки уменьшают размер текущего денежного остатка на сумму задолженности перед брокером (текущий остаток становится отрицателен при покупке на заёмные средства), – операции короткой продажи не изменяют отображаемых в таблицах лимитов по деньгам и по бумагам	Выключен

(*) Комментарий к рыночным заявкам на покупку

Расчет суммы блокируемых средств осуществляется по следующей формуле:

(Лучшая цена предложения + (Лучшая цена предложения / 100 * Процент доп. резервирования))* Кол-во бумаг в заявке * Размер лота,

где **Процент доп. резервирования** – значение параметра «% доп. резервиров. При рыночн. заявке» или «% доп. резервиров. при рыночн. заявке в разрезе классов».

(**) Комментарий к автосозданию кодов клиентов субадминистратора

Коды клиентов субадминистратора создаются в формате:

<код_субадминистратора>_<код_клиента>

Например, если код субадминистратора – SUBADM, то он может устанавливать лимиты для клиентов с кодами SUBADM_CL1, SUBADM_10345 и т.п. – после символа «_» может быть любая символьная строка.

Если включен признак «Код клиента может включать "/"», то вместо разделителя «_» также может использоваться символ «/». В этом случае для приведённого выше примера допустимо использование кода SUBADM/CL1 и т.п.

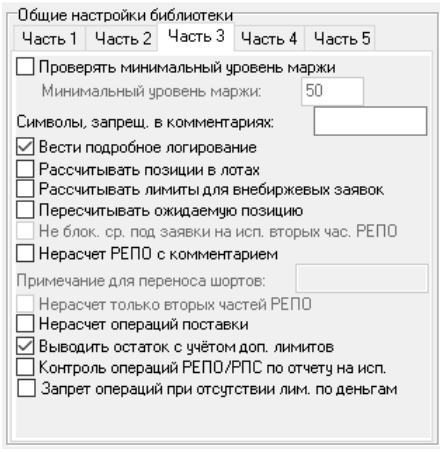
Если указан дополнительный разделитель кода субклиента, например, «N» (см. п. 12), то вместо разделителей «_» либо «/» может использоваться этот символ. В этом случае допустимо использование кода SUBADMNCL1.

Если код клиента содержит несколько разделителей, то для определения кода его субадминистратора используется символ, имеющий больший приоритет (в порядке убывания):

- Подчеркивание («_») или слеш («/»), при включенной опции «Код клиента может включать «/» (см. «Общие настройки библиотеки», вкладка «Часть 2»). Выбирается первый с конца разделитель из используемых в коде клиента.
- Настройка «Доп. разделитель кода субклиента» на странице «Клиенты / Субброкеры».

Использование двух одинаковых разделителей в коде клиента не допускается.

4.3 Общие настройки библиотеки. Часть 3



В таблице приведены параметры, настраиваемые на вкладке «Часть 3».

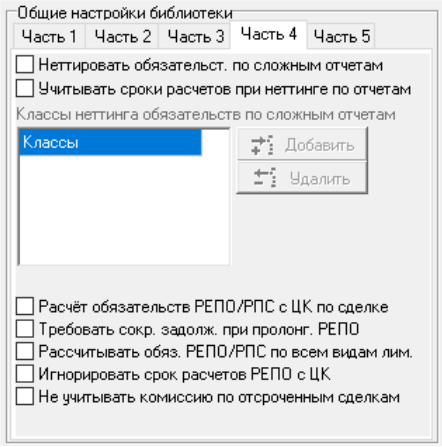
Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Проверять минимальный уровень маржи	Признак относится к динамической корректировке лимитов и включает проверку: если в результате корректировки уровень маржи снизится меньше величины, заданной параметром «Минимальный уровень маржи», то такая корректировка будет отвергнута сервером QUIK*	Выключен
_ Минимальный уровень маржи	Значение минимально допустимого уровня маржи, контролируемое при динамической корректировке лимитов	Пустое значение
Символы, запрещ. в комментариях	Перечень символов, запрещенных для использования в комментариях. Перечень задается перечислением символов подряд, без пробелов. Если в заявке обнаружен недопустимый символ, такая заявка будет отвергнута сервером QUIK	Пустое значение
Вести подробное логирование	Включение расширенной диагностики работы Дилерской библиотеки, записываемой в файл events.log	Выключен
Рассчитывать позиции в лотах	Включение отображения и расчета лимитов в лотах. Если признак выключен, лимиты по бумагам задаются и рассчитываются в штуках	Включен
Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок	Настройка влияет на операции РЕПО с кодом расчётов S0 и РПС с кодом расчетов B0. Если список «Классы расчета лимитов для	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	внебиржевых заявок» (см. п. 7) содержит значения, то настройка влияет только на операции по классам бумаг, указанным в списке, иначе – на операции всех классов РЕПО и РПС с указанными кодами расчетов. Если флажок выключен, то проверка достаточности средств на лимите Т0 при подаче заявок в указанных режимах не выполняется, проверка и блокировка лимитов осуществляются только на лимитах Т1, Т2 и т.д. Расчёты по сделке учитываются на лимитах Т1, Т2 и т.д. сразу при заключении сделки. На лимите Т0 проверка, блокировка и списание средств производятся при подаче отчёта по сделке для исполнения и её подтверждении отчётом со стороны партнёра. Если флажок установлен, то на видах лимитов Т0, Т1, Т2 и т.д. проверка и блокировка средств производятся при подаче заявок в указанных режимах. Расчёты по сделке для лимитов Т1, Т2 и т.д. производятся непосредственно при заключении сделки, а для лимита Т0 – при подтверждении обеими сторонами сделки для исполнения	
Пересчитывать ожидаемую позицию	Флажок включает учет обязательств по вторым частям РЕПО, дата исполнения которых приходится на текущий торговый день. Счета учета обязательств настраиваются на странице «Доп. теги расчетов» (см. п. 17). Признак доступен при включенной настройке «Пересчитывать сделки для исполнения» на вкладке «Часть 1» (см. п. 4.1)	Выключен
Не блок. ср. под заявки на исп. вторых час. РЕПО	Если флажок включен, то блокировка средств под заявки на исполнение вторых частей РЕПО со сроком исполнения «сегодня» не осуществляется. Если флажок выключен, то при подтверждении второй части заявки РЕПО отчетом выполняется блокировка средств на величину заявки-отчета. Признак доступен при включенной настройке «Пересчитывать ожидаемую позицию» (см. выше)	Выключен
Нерасчет РЕПО с комментарием	При включенном признаке не учитываются сделки РЕПО, у которых комментарий совпадает со значением поля «Примечание для переноса	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	шортов». Такие сделки не будут приводить к изменению денежных и бумажных лимитов	
_ Примечание для переноса шортов	Пометка, которая обозначает операцию как предназначенную для перенесения короткой позиции. Примечание может оканчиваться знаком «*», в этом случае операция будет считаться предназначенной для перенесения короткой позиции, если начальные символы значения, указанного в поле «Поручение» на форме ввода заявки, совпадают с символами примечания до знака «*». Поле доступно для редактирования при установленном флажке «Нерасчет РЕПО с комментарием» или «Пересчитывать ожидаемую позицию»	Пустое значение
Нерасчет только вторых частей РЕПО	Данная опция работает только при включенном режиме «Нерасчет РЕПО с комментарием». При её включении, первая часть сделок РЕПО будет отражена на лимитах клиентов, а вторая – нет	Выключен
Нерасчет операций поставки	Включение данной опции позволяет поставочным сделкам и заявкам не влиять на лимиты QUIK. Настройка не используется	Выключен
Выводить остаток с учетом доп. лимитов	Выбор порядка исчисления суммы, предназначенной к выводу при подаче заявки на вывод остатка средств («Вывод ДС»). При отключенном флажке сумма формируется в размере остатка на счёте, с которого выводятся средства. При включенном флажке сумма исчисляется с учётом остатков (обязательств) на других счетах	Выключен
Контроль операций РЕПО/РПС по отчету на исполн.	Включает проверку операций РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S0» и «B0») на лимите Т0 при подаче отчета на исполнение первой части (для сделок РЕПО) и отчета на исполнение (для сделок РПС)	Выключен
Запрет операций при отсутствии лим. по деньгам	Признак запрета выставления заявки (в т. ч. заявки закрытия позиции), затрагивающей валюту, по которой у клиента не задан лимит. Настройка имеет больший приоритет, чем настройка «Префикс кода клиентов» (см. п. 9)	Выключен

* – отключение признака «Проверять корректировки лимитов» на странице «Ограничения на … / Корректировка лимитов» (см. п. 21) приводит к отмене проверки минимального уровня маржи.

4.4 Общие настройки библиотеки. Часть 4



В таблице приведены параметры, настраиваемые на вкладке «Часть 4».

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Неттировать обязательст. по сложным отчетам	Неттинг проводится при подтверждении сделок для исполнения сложным отчетом и заключается в оценке покупательной способности не по каждой сделке для исполнения, а по всем сделкам. При неттировании оцениваются общее количество бумаг и общий объем денежных средств по всем сделкам, и, исходя из этого, рассчитывается итоговое направление обязательств по каждому инструменту, с учетом кода клиента. См. комментарий к описанию настройки	Выключен
Учитывать сроки расчетов при неттинге по отчетам	Проверка достаточности средств по каждой сделке для исполнения, включенной в сложный отчет, на всех видах лимитов. Проверка осуществляется при включенном флажке «Неттировать обязательст. по сложным отчетам» (см. п. 4.4)	Выключен
Классы неттинга обязательств по сложным отчетам	Список классов, для которых нужно рассчитывать неттинг сложных отчетов по заявкам-отчетам. Список доступен для редактирования при включенной опции «Неттировать обязательства по сложным отчетам». Настройка влияет на отображение расчетов по сделкам для исполнения РЕПО с ЦК в клиринг.	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	Состояние настройки определяет, производится ли расчет по сделкам для исполнения в режимах РЕПО с ЦК и РПС с ЦК при их исполнении в клиринг на позиции клиента. Если класс, в котором заключена сделка для исполнения, добавлен в данную настройку, то при исполнении в клиринг движение средств на позиции клиента не происходит. Иначе, расчёты по сделке, исполняющейся в клиринг, отображаются на позиции клиента	
Расчет обязательств РЕПО/РПС с ЦК по сделке	Блокировка/списание средств по сделкам РЕПО/РПС с ЦК на видах лимитов Т0 независимо от кода расчетов. При включенной опции сделки для исполнения первой части РЕПО с ЦК и кодом расчетов Y0, а также сделки для исполнения РПС с ЦК с кодом расчетов с Y0 игнорируются. См. комментарий к описанию настройки	Выключен
Требовать сокр. задолж. при пролонг. РЕПО	Признак ограничения количества/суммы РЕПО при пролонгации с учетом текущей позиции и параметров пролонгируемой сделки	Выключен
Рассчитывать обязательства РЕПО/РПС по всем видам лимитов	Опция позволяет отключить учет срока РЕПО, указанного в заявке, при проверке лимитов клиента. При включенной опции проверка наличия ресурсов под выставляемую заявку производится начиная с вида лимитов, соответствующего классу инструментов и коду расчётов, на всех последующих видах лимитов. Настройка не влияет на режимы «РЕПО с ЦК»	Выключен
Игнорировать срок расчетов РЕПО с ЦК	Опция позволяет отключить учет срока РЕПО, указанного в заявке, при изменении лимитов. При включенной опции диапазон изменяемых видов лимитов не зависит от срока РЕПО. Изменения производятся, начиная с вида лимита, к которому осуществлена привязка класса и кодов расчета и далее на всех последующих видах лимитов. Настройка используется только в режиме торгов «РЕПО с ЦК адресное»	Выключен
Не учитывать комиссию по отсроченным сделкам	Опция позволяет отключить учет комиссии брокера и торговой системы при подтверждении сделки для исполнения с отложенными расчетами (адресная сделка РПС и первая часть сделки РЕПО)	Выключен

Комментарий к настройке «Неттировать обязательст. по сложным отчетам»:

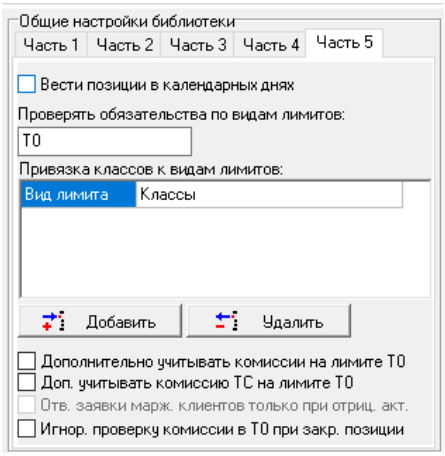
Для неттинга обязательств по сложным отчетам требуется соблюдение следующих условий:

- Все классы, участвующие в неттинге, перечислены в списке «Классы неттинга обязательств по сложным отчетам».
- Все валюты, участвующие в расчётах, перечислены в файле с кросс-курсами сервера QUIK (как правило, это crossrate.ini в папке с файлами сервера QUIK) либо оттранслированы Модулем формирования кросс-курсов (CrossRateTW).
- Тег и валюта расчетов, по которым производятся проверка денежных нетто-обязательств и блокировка средств под сложный отчет, определяются привязкой тега (для обязательств в рублях) или тега и валюты к инструменту RUR в настройке «Параметры учета неторговых поручений».
- Если тег и валюта для инструмента RUR в настройке «Параметры учета неторговых поручений» не заданы, то они определяются по классу и инструменту первой сделки, включенной в отчет: тег согласно настройке «Теги расчётов для режимов торгов», а валюта – валютой номинала.
- Если используется неттирование без настройки «Параметры учета неторговых поручений», то расчёты по всем сделкам, включаемым в один отчёт, должны проводиться на одном и том же теге, и в одной и той же валюте расчетов. Иначе корректность учёта сделок для исполнения на лимитах клиента не гарантируется.

Комментарий к настройке «Расчет обязательств РЕПО/РПС с ЦК по сделке»:

- Если опция отключена (по умолчанию), то блокировка средств происходит в момент выставления внебиржевой заявки, а разблокировка и движение - в момент исполнения заявки-отчета по сделке для исполнения. При этом в день исполнения второй части РЕПО с ЦК загрузка лимита по виду лимита Т0 осуществляется БЕЗ учета ее исполнения, а движение средств по виду лимита Т0 происходит в момент исполнения соответствующей сделки для исполнения.
- Если опция включена, то блокировка средств происходит в момент выставления внебиржевой заявки, а разблокировка и движение - в момент ее исполнения. При этом в день исполнения второй части РЕПО с ЦК загрузка лимитов с утра осуществляется с учетом исполнения второй части РЕПО с ЦК. Досрочное исполнение сделки РЕПО с ЦК не поддерживается. При этом сделки для исполнения первой части РЕПО с ЦК и сделки для исполнения РПС с ЦК игнорируются (контроль лимитов и движение средств при их подтверждении не осуществляется). Досрочное подтверждение сделки для исполнения второй части РЕПО с ЦК не поддерживается.

4.5 Общие настройки библиотеки. Часть 5



Настройка учета обязательств клиентов в разрезе различных дат исполнения этих обязательств. Плановая позиция на каждую дату исполнения может отображаться на лимитах, имеющих различный «вид лимита».

Например:

- Лимиты с видом «Т0» отражают позиции клиента на текущий торговый день;
- Лимиты с видом «Т2» отражают плановые позиции клиента с учётом обязательств по сделкам, которые исполнятся в день «Т0», «Т+1» и «Т+2».

В таблице приведены параметры, настраиваемые на вкладке «Часть 5»:

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Вести позиции в календарных днях	Признак ведения позиций не в торговых, а в календарных днях в разрезе дат вместо видов лимитов. Используется только для схемы кредитования «Валютное лимитирование» (FX)	Опция отключена
Проверять обязательства по видам лимитов	Список значений видов лимитов через запятую, по которым производится расчет обязательств по сделкам. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа Т, за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания	Т0
Привязка классов к видам лимитов	Список соответствий между видами лимитов и классами ценных бумаг для определения вида лимита текущей операции. Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13	
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа Т, за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания	Т0
_ Классы	Список классов инструментов, перечисленных через запятую	
Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссии брокера и торговой системы по таким операциям учитываются не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов	Опция отключена

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	лимитов, то эти комиссии учитываются также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет больший приоритет, чем настройка «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0»	
Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссия торговой системы по таким операциям учитывается не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом комиссия брокера учитывается только на лимите операции. Если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов лимитов, то комиссия торговой системы учитывается также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0»	Опция отключена
Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах	Используется, если включена хотя бы одна из настроек – «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» или «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0». Настройка влияет на проверку покупательной способности для клиентов с типом кредитования «по плечу», «по дисконтам» и «МД+». При включенной настройке заявки отвергаются, если, с учетом комиссии по выставляемой заявке, оценка текущих активов клиента на лимите Т0 становится отрицательной. При отключенной настройке для клиентов с типом кредитования «по плечу» блокировка и списание комиссии на лимите Т0 проверяется до ограничительного уровня маржи на лимите Т0, а для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» проверяется, что стоимость портфеля превышает значение вычисляемой скорректированной маржи	Опция отключена
Игнорировать проверку комиссии в Т0 при закрытии позиции	Настройка требует включения настройки «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» и перекрывает действие настройки «Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах» для заявок на закрытие позиции. Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» и «МД+».	Опция отключена

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	При включенной настройке отключается проверка достаточности средств под комиссию на лимите Т0 при проверке заявок, сокращающих модуль позиции по инструменту на лимите по плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов», например Т95). При этом блокировка комиссии на лимите Т0 по заявке и ее списание по сделке все равно выполняется	

Пример:

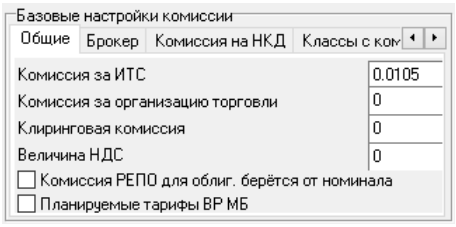
Пусть заданы следующие виды лимитов: Т0, Т2.

Пусть для классов TQBR, EQNE, EQNL задан вид лимита Т0. Тогда операции по данным классам будут учитываться и проверяться для лимитов вида Т0 и Т2.

Пусть для классов TQBR, TQNE, TQNL задан вид лимита Т2. Тогда операции по данным классам будут учитываться и проверяться только для лимитов вида Т2.

Для всех остальных классов, не указанных в настройке, операции учитываются и проверяются для лимитов вида Т0 и Т2. Таким образом, отсутствие настройки интерпретируется как настройка привязки к лимитам вида Т0.

4.6 Базовые настройки комиссии



В данной секции устанавливаются значения комиссионного вознаграждения и других сборов, в размере которых сервер QUIK блокирует средства под исполнение заявок.

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Вкладка «Общие»		
*Комиссия за ИТС	Комиссионное вознаграждение Московской Биржи по договорам о предоставлении интегрированного технологического сервиса (ИТС), в процентах от	0,0105

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	
*Комиссия за организацию торговли	Комиссионное вознаграждение, которое взимается в пользу организатора торговли, в процентах от объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	0
*Клиринговая комиссия	Величина клиринговой комиссии, в процентах от объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	0
Величина НДС	Величина НДС, списываемого с клиентского счёта дополнительно к брокерской комиссии, в процентах от начисленной комиссии брокера	0
Комиссия РЕПО для облиг. берется от номинала	Включает расчет комиссии, по сделкам РЕПО с облигациями, исходя из номинала облигаций, а не из объёма сделки	Выключен
Вкладка «Брокер»		
Комиссия брокера (фиксированная)	Комиссия, взимаемая брокером с клиентов, в % от объёма сделки	0.5
Комиссия за сделки с голоса (акции)	Комиссия за сделку, выставленную брокером по просьбе клиента через биржевой терминал	0
Комиссия за сделки с голоса (облигации)	Комиссия за сделку, выставленную брокером по просьбе клиента через биржевой терминал	0
Тип комиссии	Выбор типа комиссии. Возможные значения: _ «Фиксированная» (в процентах от объема сделки); _ «За сделку» (в валюте расчетов за сделку, независимо от объема сделки)	Фиксированная
Вкладка «Комиссия на НКД»		
Классы с учетом НКД при расчете комиссии брокера	Классы, для которых при расчете комиссии брокера, помимо стоимости облигации, учитывается накопленный купонный доход (НКД). Также для указанных классов НКД учитывается в суммарном торговом обороте при использовании ставок комиссии по шкале	
_ Все классы	НКД учитывается для всех классов	
_ По списку	НКД учитывается для выбранных классов	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Вкладка «Классы с комиссией МБ»		
Классы с комиссией МБ	Настройка класса МБ, ставки комиссии по умолчанию которого необходимо использовать при расчете комиссии ТС в перечисленных классах. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройки комиссии ТС	
_ Класс МБ	Код класса МБ, с которого берутся ставки комиссий	
_ Классы	Список кодов классов через запятую, к которым применяется комиссия класса МБ	
Вкладка «Новые тарифы МБ»		
Новые тарифы на рынке акций МБ	Включает расчет комиссии в соответствии с обновленными тарифами комиссии фондового рынка МБ	Выключен

* – параметр не влияет на расчет комиссий на классах Московской Биржи.

4.7 Настройки комиссии брокера по умолчанию

В данной секции настраивается конфигурация шкалы брокерской комиссии. Секция активизируется при настройке взимания брокерской комиссии с использованием шкалы (раздел «Общие параметры», секция «Общие настройки библиотеки, часть 1», флажок «Использовать шкалу комиссии»).

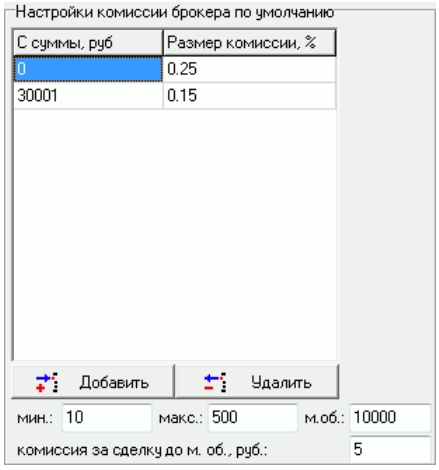
Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Настройки комиссии брокера по умолчанию	Настройка шкалы комиссии в зависимости от дневного оборота клиента*	
_ С суммы, руб	Нижняя граница оборота, к которой применяется данная ставка комиссии, в валюте расчетов	Пустое значение
_ Размер комиссии,%	Величина комиссионного вознаграждения, в процентах	Пустое значение
Мин.	Минимальное значение комиссионного вознаграждения, взимаемое с клиента в день, когда клиент произвёл хотя бы одну торговую операцию, в валюте расчетов	Пустое значение

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Макс.	Максимальное значение комиссионного вознаграждения, взимаемое с клиента за один торговый день, в валюте расчетов	Пустое значение
М.об	Минимальный дневной оборот, с которого начисляется комиссия, в валюте расчетов	Пустое значение
Комиссия за сделку до мин. об.	Фиксированная комиссия за каждую сделку, в валюте расчетов. Комиссия взимается до тех пор, пока дневной оборот не превысит значения «М. об.». По умолчанию поле пустое	

Валюта, в которой интерпретируются значения суммы, комиссии и оборота в данной настройке, может быть изменена для заданного списка классов (подробнее см. п. 6.2.1).

Комментарий к формированию шкалы комиссии

Шкала комиссии брокера задается следующим образом: при нажатии на кнопку «Добавить» в таблице появляется новая строка. В ней нужно ввести в колонке «С суммы, руб.» граничную величину оборота клиента за торговую сессию, а в колонке «Размер комиссии» – размер комиссионного вознаграждения в процентах, который будет взиматься с клиента, как только дневной оборот торговых операций по его счёту станет равным значению в колонке «С суммы, руб», или превысит эту сумму.



Например, шкала может иметь вид:

С суммы, руб.	Размер комиссии
0	0.3

С суммы, руб.	Размер комиссии
100000	0.2
250000	0.1
1000000	0.01

Этот пример означает следующее: если оборот клиента меньше 100 000 руб., с него взимается комиссия 0.3%, если оборот больше 100 000р., но меньше 250 000р. – 0.2% и т.д.

Для отдельных клиентов можно установить персональные настройки шкалы на странице «Клиенты/Комиссия брокера», выбирая их в списке и задавая собственно данные о шкале в секции «Настройки шкалы комиссии». При наличии у клиента персональных настроек расчёта комиссии, общие для всех настройки брокерской комиссии, при расчёте комиссии по его сделкам, игнорируются.

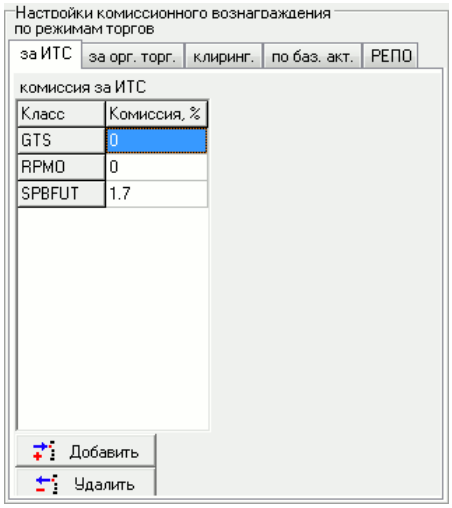
При использовании шкалы комиссии, в некоторых случаях может возникнуть потребность задать комиссию на клиента или комиссию по умолчанию в стандартной форме, т.е. когда вне зависимости от оборота действует единая ставка. В этом случае, при формировании шкалы нужно в таблицу «Настройки шкалы комиссии» добавить одну строку, например:

С суммы, руб.	Размер комиссии
0	0.3

При такой настройке шкалы, со всех сделок, вне зависимости от дневного оборота, будет взиматься комиссия в размере 0.3%.

4.8 Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов

В этой секции настраиваются параметры «за ИТС», «за орг. торг.», «клиринг.», «по баз. акт.» и «РЕПО» для определенных режимов торгов, если они должны отличаться от назначенных по умолчанию.



На вкладках «за ИТС», «за орг. торг.», «клиринг.» нажмите кнопку «Добавить» для включения в список нового класса, а на вкладке «по баз. акт.» – для включения в список новой строки с кодом базового актива. Значение комиссии устанавливается в ячейке «Комиссия».

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
*За ИТС	Комиссионное вознаграждение Московской Биржи по договорам о предоставлении интегрированного технологического сервиса (ИТС), в процентах от объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	Пустое значение
*За организацию торговли	Комиссионное вознаграждение, которое взимается в пользу организатора торговли, в процентах от объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	Пустое значение
*Клиринговая	Величина клиринговой комиссии, в процентах от объёма сделки. У классов РЕПО срок РЕПО не учитывается	Пустое значение
По базовому активу	Величина комиссии, по сделкам с фьючерсами на ФОРТС, в валюте расчетов за лот. По сделкам, приводящим к открытию и закрытию ПОЗИЦИИ в течение одного торгового дня, взимается ½ комиссии от обычной безадресной сделки. Задаётся индивидуально для каждого базового актива. Настройка не работает совместно с признаком «Использовать комиссию ТС» и используется только для расчетов настроенной единой денежной позиции	Пустое значение
РЕПО	Величина комиссии РЕПО, задается в процентах от объема сделки. Подробнее см. Вкладка «РЕПО»	Пустое значение

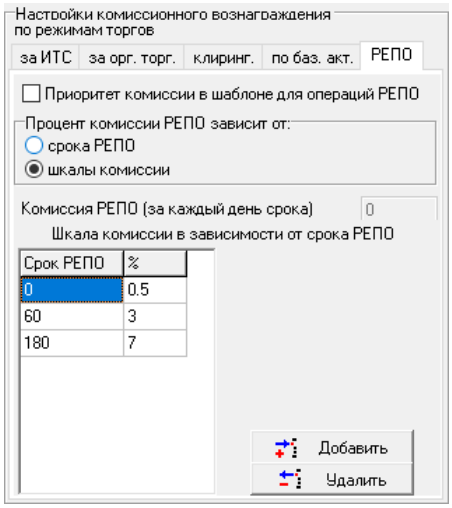
* – при установлении значений комиссии на классах Московской Биржи отличных от принятых на рынках (при пустом значении ячейки автоматически используется значение комиссии принятое на

рынке) необходимо перечислить данные классы в параметре «Классы с игнорированием ограничений на минимальный размер комиссии ТС» на странице «Классы».

Вкладка «РЕПО»

- «Приоритет комиссии в шаблоне для операций РЕПО» – выбор приоритета комиссии, задаваемой на код клиента (см. п. 10) или в шаблоне по комиссии (см. п. 14), относительно глобальной настройки комиссии РЕПО на данной вкладке:
  - Если флажок снят (по умолчанию), глобальная настройка комиссии РЕПО имеет более высокий приоритет;
  - Если флажок установлен, комиссия, настроенная на клиента или в шаблоне, в том числе через тарифный план (за исключением групп классов, для которых выбран тип шкалы комиссии «Нулевая комиссия»), имеет более высокий приоритет, чем глобальная настройка комиссии РЕПО.

  Настройка не влияет на приоритет настроек комиссий, задаваемых на конкретный класс, и настроек «Комиссия РЕПО» в шаблоне и в индивидуальных настройках: они всегда более приоритетны, чем глобальные настройки комиссии РЕПО.
- «Процент комиссии РЕПО зависит от» – выбор способа настройки комиссии:
  - «срока РЕПО» – значение комиссии задается в поле «Комиссия РЕПО (за каждый день срока)». Расчет производится по следующей формуле: **«Комиссия» = «Срок РЕПО» * «процентная ставка» * «Объем сделки РЕПО»**;
  - «шкалы комиссии» – значение комиссии задается в таблице «Шкала комиссии в зависимости от срока РЕПО». Расчет производится по следующей формуле: **«Комиссия» = «процентная ставка за период» * «Объем сделки РЕПО»**.

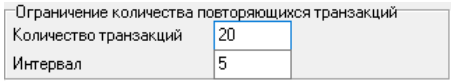


В примере, представленном на скриншоте, «Шкала комиссии» задает комиссию на сделки в пределах интервала, начиная с нулевого срока:

- от 0 дней до 59 – комиссия по ставке 0,5% от объема сделки, независимо от срока РЕПО;
- от 60 дней до 179 – комиссия по ставке 3% от объема сделки, независимо от срока РЕПО;
- 180 дней – комиссия по ставке 7% от объема сделки, независимо от срока РЕПО.

Настройки комиссии РЕПО имеют более низкий приоритет по отношению к настройке комиссии по классам, задаваемой на странице «Брокерская комиссия» (см. п. 6).

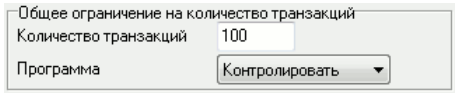
4.9 Ограничение количества повторяющихся транзакций



В данной секции настраивается ограничение количества одинаковых транзакций, отправляемых пользователями в заданный интервал времени. Количество транзакций контролируется в рамках каждого пользователя в разрезе каждого класса и инструмента. Транзакции по разным классам, инструментам и пользователям не суммируются.

Максимальное допустимое количество одинаковых транзакций задается в поле «Количество транзакций»; интервал времени в секундах, в течение которого допускается подать указанное количество одинаковых транзакций, задается в поле «Интервал» (по умолчанию – 1 секунда).

4.10 Общее ограничение на количество транзакций



В данной секции настраивается ограничение количества транзакций, отправляемых пользователями в секунду.

Для включения / отключения контроля количества транзакций выберите соответствующее значение в поле «Программа»: «Контролировать» / «Не контролировать».

Максимальное допустимое количество транзакций, отправляемых пользователями в секунду, задается в поле «Количество транзакций».

Следующие виды транзакций подвергаются проверке:

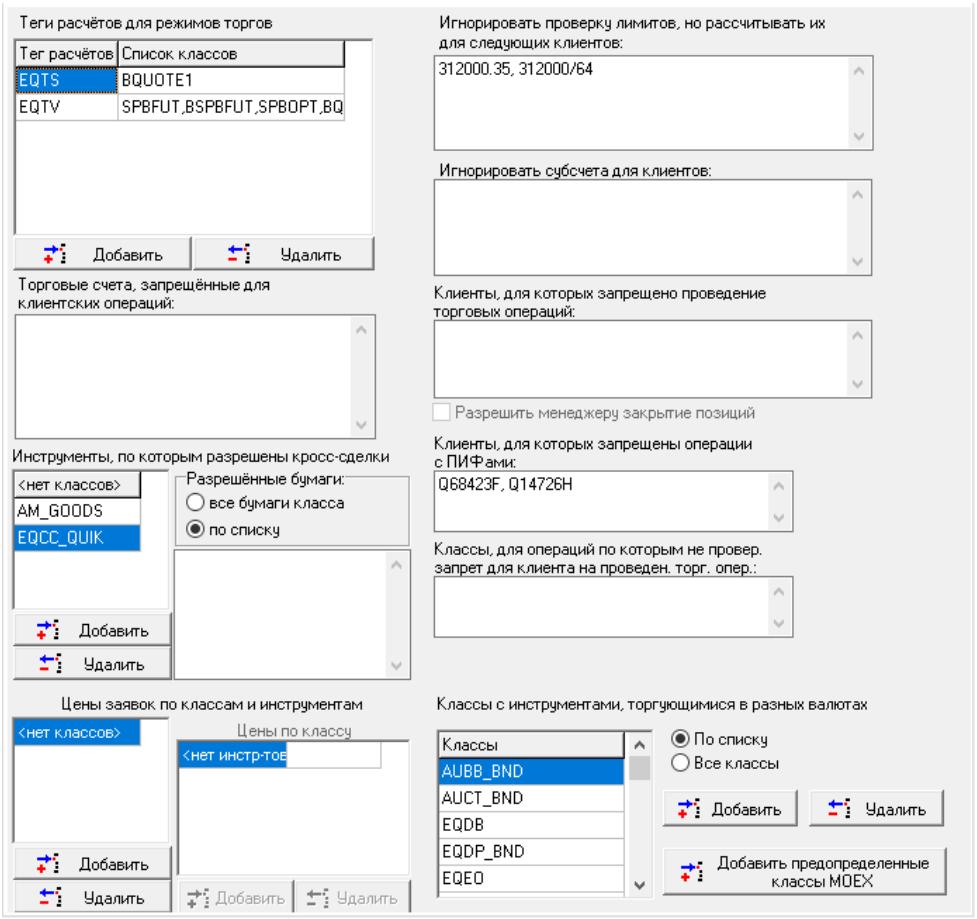
- Ввод заявки;
- Ввод стоп-заявки;
- Ввод внебиржевой заявки;
- Ввод заявки-отчета РПС/РЕПО;
- Снятие заявки;
- Снятие стоп-заявки;
- Снятие внебиржевой заявки;
- Снятие заявки-отчета РПС/РЕПО;
- Перестановка заявок (FORTS).

Изменение данной настройки применяется только после переподключения пользователя.

Аналогичная настройка на вкладке «Пользователи» имеет более высокий приоритет, чем данная настройка.

5. Другие параметры

На этой странице устанавливается соответствие между классами инструментов и тегами расчетов, а также настраиваются списки исключений из правил, заданных на странице «Общие параметры».



Параметр	Назначение
Теги расчётов для режимов торгов	Список соответствий между классами инструментов и т.н. кодами (тегами) расчетов. Подробное описание настройки и список значений по умолчанию см. в Комментарии
_ Тег расчётов	Тег расчетов
_ Список классов	Список классов инструментов, перечисленных через запятую
Торговые счета, запрещенные для клиентских операций	Список торговых счетов, по которым запрещены операции клиентов. Счета в списке разделяются запятой

Параметр	Назначение
Инструменты, по которым разрешены кросс-сделки	Настройка списка бумаг, по которым будет выполняться замена кодов при кросс-сделке (о применении см. п. 11). Если список настроен, то замены при кросс-сделке разрешены только по бумагам из списка, если список пустой – то по всем бумагам
_ Класс	Выбор класса инструментов, по которому разрешены замены кодов
_ Разрешенные бумаги	Настройка списка бумаг из выбранного класса, на которые распространяется замена кодов:
_ Все бумаги класса	На все инструменты класса
_ По списку	На инструменты из списка внизу. Коды инструментов указываются через запятую
Цены заявок по классам и инструментам	Настройка списка инструментов, по которым будет использоваться заданное значение цены при обработке заявок. Замена цены на заданную в настройке осуществляется в следующих случаях: _ при расчёте покупательной способности; _ при блокировке средств под заявку; _ при вычислении комиссионного вознаграждения, а также блокировании средств под него; _ при оценке активных заявок по инструменту. При исполнении сделки со счёта списывается реальный объём сделки и комиссия, рассчитанная от реального объёма
_ Класс	Выбор класса инструментов, по которому используется замена цены
_ Цены по классу	Настройка списка инструментов из выбранного класса, на которые распространяется замена цены:
_ Инструменты	Инструмент, для которого назначается цена
_ Цена	Цена, которая будет использоваться при обработке заявки по данному инструменту. Для акций цена указывается в валюте инструмента, для облигаций – в процентах от номинала
Игнорировать проверку лимитов, но рассчитывать их для следующих клиентов	Список кодов клиентов, от которых принимаются заявки без проверки достаточности средств. При этом операции по перечисленным кодам клиентов будут обсчитываться на денежных лимитах и лимитах по бумагам. Коды в списке разделяются запятой
Игнорировать субсчета для клиентов	Список кодов клиентов, которые рассматриваются как основные. Операции по кодам клиентов, для которых основной код является префиксом, учитываются на основном коде клиента. Например, если в списке указан код «55», и получена заявка

Параметр	Назначение
	с кодом клиента «55_5», то она проверяется на достаточность средств как заявка с кодом «55». Коды в списке разделяются запятой. Данная настройка предназначена для организации иерархии субсчетов, проверки по которым необходимо выполнять по вышестоящему счету
Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций	Список кодов клиентов, по которым запрещено проведение торговых операций. Коды в списке разделяются запятой. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Ограничения на … / Типы заявок» см. п. 29
*Разрешить менеджеру закрытие позиций	При включенной настройке пользователь с правами менеджера может выставлять заявки только на сокращение или закрытие позиции по бумаге. Заявки на удлинение или переворот позиции запрещены. При отключенной настройке совершение любых операций запрещено. Редактирование настройки доступно, если настройка «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций» содержит непустой список кодов клиентов. Флажок «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах пользователя по классу операции должен быть включен
Клиенты, для которых запрещены операции с ПИФами	Список кодов клиентов, по которым запрещено проведение операций с ПИФами. Коды в списке разделяются запятой. Имеется возможность задать префикс клиентского кода
Классы, для операций по которым не провер. запрет для клиента на проведен. торг. опер.	Список классов, перечисленных через запятую, по которым не проверяется запрет на проведение торговых операций для клиента
Классы с инструментами, торгующимися в разных валютах	Список классов, в которых есть инструменты, одновременно торгуемые в других классах с расчетами в валюте, отличной от валюты расчетов в исходном классе. Для корректного учета операций по инструментам из таких классов используются технические лимиты, на которых хранится информация о блокировках в соответствующей валюте
_ Класс	Классы с инструментами, торгующимися в разных валютах. В настройке следует указывать ВСЕ классы, в которых торгуются инструменты с расчетами в разных валютах. Например, если бумага торгуется в трех классах, в двух из них валюта расчетов одинакова, а в третьем отличается, то указать в настройке надо все три класса
_ По списку	Настройка списка классов. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом кода бумаги. При нажатии на

Параметр	Назначение
	кнопку «Добавить предопределенные классы MOEX» к списку выбранных классов добавляется список предопределенных классов MOEX
_ Все классы	Выбор всех классов

* – действие данной настройки не распространяется на операции на срочном рынке.

Комментарий к применению тегов расчетов

Настройка соответствия тегов расчетов и классов инструментов применяется, если сервер QUIK настроен для работы с несколькими биржевыми торговыми системами (Московская Биржа, РТС, ФБ СПб), или при необходимости установки клиенту единой позиции по денежным средствам для работы на всех торговых площадках.
По умолчанию для каждой торговой площадки (и класса инструментов) используется свой тег расчетов – символьный идентификатор, присваиваемый совокупной денежной позиции брокера для работы с торговой площадкой или классом инструментов.

Соответствие тегов расчетов и классов инструментов по умолчанию:

Тег расчетов	Список классов
BILL	MAIN, MAIC, SES2, NEGD, RPCB, RPCD, RPDD, RPFB, RPFD, BOBR, EXRP
EQTV	CROSSRATE,EQBREMU,EQBR,EQBS,EQNE,EQNL,SMAL,EQLV,EQLI,PSEQ,PSES,PSNE,PSNL,PSLV, PSLI,PSI2,RPEQ,EQNB,EQNO,EQOB,EQOS,EQOV,GAZP,AUCT_BND,AUCT,AUBB,AUBB_BND,PSNB, PSNO,PSOB,PSOS,PSOV,PSAU,PSSU,PSBB,PSAU_BND,RPMO,RPMA,RPQI,RPQI_BND,EQEU,PSEU, RPEU,RPGO,EQUS,EQGO,PSUS,PSGO,EQEO,RPNG,RPFG,GZPM,GZPR,GZSM,PSGZ,EQDB,PSDB, EQDE,PSDE,TQDE,EQCC,EQOC,RPCC,RPOC,PSCC,PSOC,EQQI,PSQI,OQQI,PSQI_BND,EQRP, EQRP_BND,PSRP,PSRP_BND,TADM,TADM_BND,PSTN,PSTN_BND,PSTD,RFND,RFND_BND,RFNE, RFNE_BND,RFNU,RFNU_BND,TRAN,TQBR,TQBS,TQLV,TQLI,TQNE,TQQI,TQNL,EQTD,TQOB,TQOS, TQNO,TQOV,TQNB,TQUS,TQEU,TQIF,TQTF,TQBD,TQFD,PTFD,PSFD,TQFE,PTFE,PSFE,TQPD,PSPD, PTPD,TQPE,PSPE,PTPE,FKFW,TQTD,TQOD,PTSD,PTTD,PTOD,PSSD,TQDB,EQWP,PSRD,PSRE, EQRD,EQRE,EQWD,EQWE,EQRD_BND,EQRE_BND,EQWP_BND,PSRD_BND,PSRE_BND, EQWD_BND,EQWE_BND,PTEQ,PTES,PTNL,PTLV,PTLI,PTNE,PTQI,PTDE,PTTF,PTIF,PTTC,PTQI_BND, PTOB,PTOS,PTNO,PTOV,PTNB,PTUS,PTEU,NADM,NADM_BND,FBOB,FBOX,FBCX,EQYO,PSYO,PACY, PAGB,TQOY,PTOY,EQRY,PSRY,EQRY_BND,PSRY_BND,GURP,GUOW,GUSW,GUOM,GUSM,GUTM, GUUM,GUOY,PUGC,DADU,NDPU,TDPU,FBCB,FBCE,FBCU,FBFX,FBCB_BND,FBCE_BND,FBCU_BND, FBFX_BND,GCOM,GCOW,GCRP,GCSM,GCSW,GCTM,GCUM,PAEU,PAUS,PSBU,PSBE,PAEU_BND, PAUS_BND,PSBU_BND,PSBE_BND,PSEO,PSGC,PSIF,PSTF,RPEO,RPEY,RPUA_MOEX,RPUO,TQQD, TQDD,PTDD,PSDD,EQMP,EQMD,EQME,EQTP,ETQD,EQTE,EQMP_BND,EQMD_BND,EQME_BND, EQTP_BND,ETQD_BND,EQTE_BND,LIQB,LIQO,LIQR,LIQB_BND,LIQO_BND,LIQR_BND,TQDP, TQCB,FKRP,FKOW,FKSW,FKOM,FKSM,FKTM,FKUM,FKOY,GCNM,GUNM,GENM,GESM,GETM,TQPI, PSPI,PTPI,PTOE,PTDB,PTED,PTUD,PTIR,PTIU,PTIE,PTIY,TQOE,TQRD,TQUD,TQED,TQIR,TQIU,

Тег расчетов	Список классов
	TQIE,TQIY,PSED,PSUD,PSIR,PSIU,PSIE,PSIY,PACT,FFCB,FFCB_BND,FFCB_BKT,FQBR,FTEQ,FSEQ, FQDE,FTDE,FSDE,OCBR,OCBU,OCTR,OCTU,FSRP,FSOW,FSSW,FSOM,FSFW,TQDU,TQTE,EQWY, EQWY_BND,EQMY,EQMY_BND,EQTY,EQTY_BND,GYRP,GYOW,GYSW,GYOM,GYSM,GYTM,GYUM, GYNM,GYOY,PYGC,FCOW,FCSW,FCOM,FCSM,FCTM,FCUM,FCNM,FCOY,CTEQ,CTES,CTOB,CTOD, CTOE,CTOS,CTOY,CTSD,CTSE
MSET	MSE
RTSG	GTS
RSGP	FUTUX
SPBG	SPBGKO
SPBS	SPBSPT
SPCG	SPCGKO, SPCCOR, SPCRDC, SPCNDC, SPCREP

В рамках одного тега расчетов значения, заданные вручную, дополняют значения по умолчанию. Для класса значение тега, заданное вручную, имеет больший приоритет, чем значение по умолчанию.

Нажатием на кнопку «Добавить» тег расчета добавляется в список. После этого в колонке «Список классов» через запятую вводятся классы инструментов, соответствующие данному коду.

Пример:

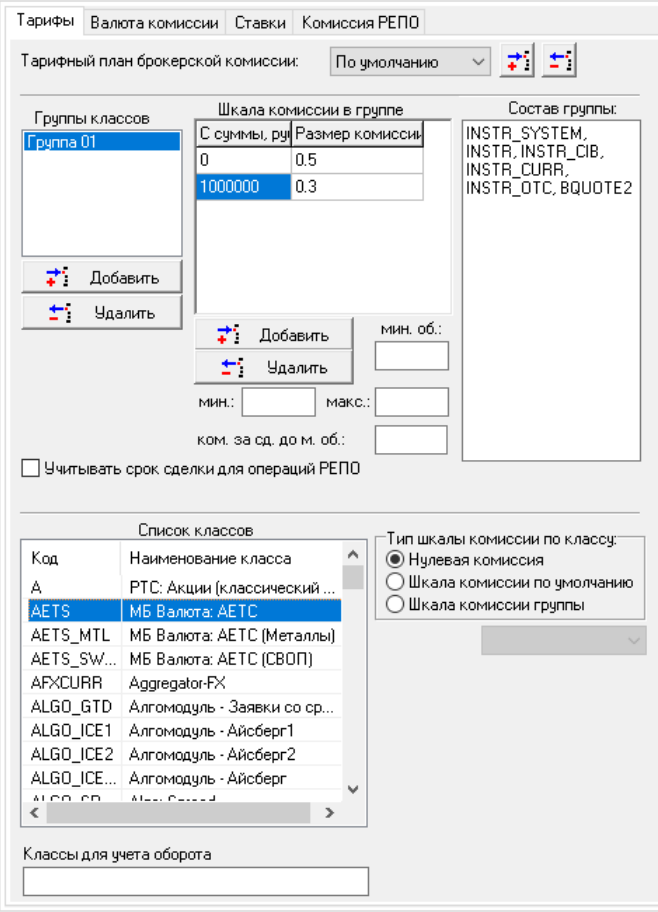
Тег расчетов	Список классов
BILL	MAIN,MAIC

В приведенном примере указано, что тег расчетов «BILL» используется для режимов торгов «ГКО» и «ГЦБ: Период закрытия».

6. Брокерская комиссия

Раздел предназначен для настройки брокерской комиссии, если она отличается для нескольких классов инструментов.

6.1 Тарифы



6.1.1 Шкала брокерской комиссии для классов

> **В следующих случаях рекомендуется обратиться в Службу технической поддержки QUIK (quiksupport@arqatech.com):**
>
> 1. **Если планируете использовать тарифные планы для комиссии типа «Шкала комиссии» (в том числе для тарифного плана «По умолчанию») в шаблоне для пользователя (см. п. 14).**
> 2. **При получении письма с темой «Dealer library <идентификатор фирмы> for <идентификатор сервера>: ERROR» и текстом «Not enough parameters [K] to calculate money limits, [K'] required», а также если в лог-файл выводится диагностика с аналогичным текстом при попытке запуска сервера QUIK.**

Тарифный план представляет собой совокупность групп классов, где каждая группа имеет свою шкалу комиссии.

Для редактирования списка тарифных планов используются кнопки «Добавить тарифный план» и «Удалить тарифный план».

Классы можно объединить в группу для применения к ним одинаковой шкалы брокерской комиссии. Разделять все классы на группы не обязательно. Если класс не включен в группу, то к нему может быть применена шкала комиссии по умолчанию или нулевая комиссия.

Параметр	Назначение
Тарифный план брокерской комиссии	Название тарифного плана. Новый тарифный план добавляется в список нажатием кнопки «Добавить тарифный план». Тарифный план «по умолчанию» перенастраивается, наравне с другими тарифными планами
Группы классов	Список групп классов. Новая группа добавляется нажатием кнопки «Добавить». Название группы присваивается автоматически
Шкала комиссии в группе	Шкала брокерской комиссии для классов инструментов в данной группе:
_ С суммы, руб.	Нижняя граница дневного оборота клиента, с которой начинается применение данной ставки комиссии
_ Размер комиссии	Величина комиссионного вознаграждения в процентах
Мин.	Минимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
Макс.	Максимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
Мин.об	Минимальный дневной оборот, с которого начисляется комиссия, в валюте расчетов
Ком. за сд. до м. об.	Фиксированная комиссия за каждую сделку в валюте расчетов. Комиссия взимается до тех пор, пока дневной оборот не превысит значения минимального оборота («Мин. об.»). По умолчанию поле пустое
Состав группы	Список идентификаторов классов, включенных в группу
Учитывать срок сделки для операций РЕПО	Признак того, что брокерская комиссия задана за каждый день срока РЕПО (комиссия дополнительно умножается на календарный срок сделки РЕПО). Признак учитывается только для операций РЕПО (РЕПО-М) и РЕПО с ЦК

> **Валюта, в которой интерпретируются значения суммы, комиссии и оборота в данной настройке, может быть изменена для заданного списка классов (подробнее см. п. 6.2.1).**

Список «Состав группы» недоступен для редактирования. Чтобы заполнить список, выполните следующие действия:

1. В таблице «Список классов» выберите требуемый класс инструментов.
2. Установите переключатель «Тип шкалы комиссии по классу» в значение «Шкала комиссии по группе».
3. В окне со списком групп выберите название группы, в которую включается данный класс.

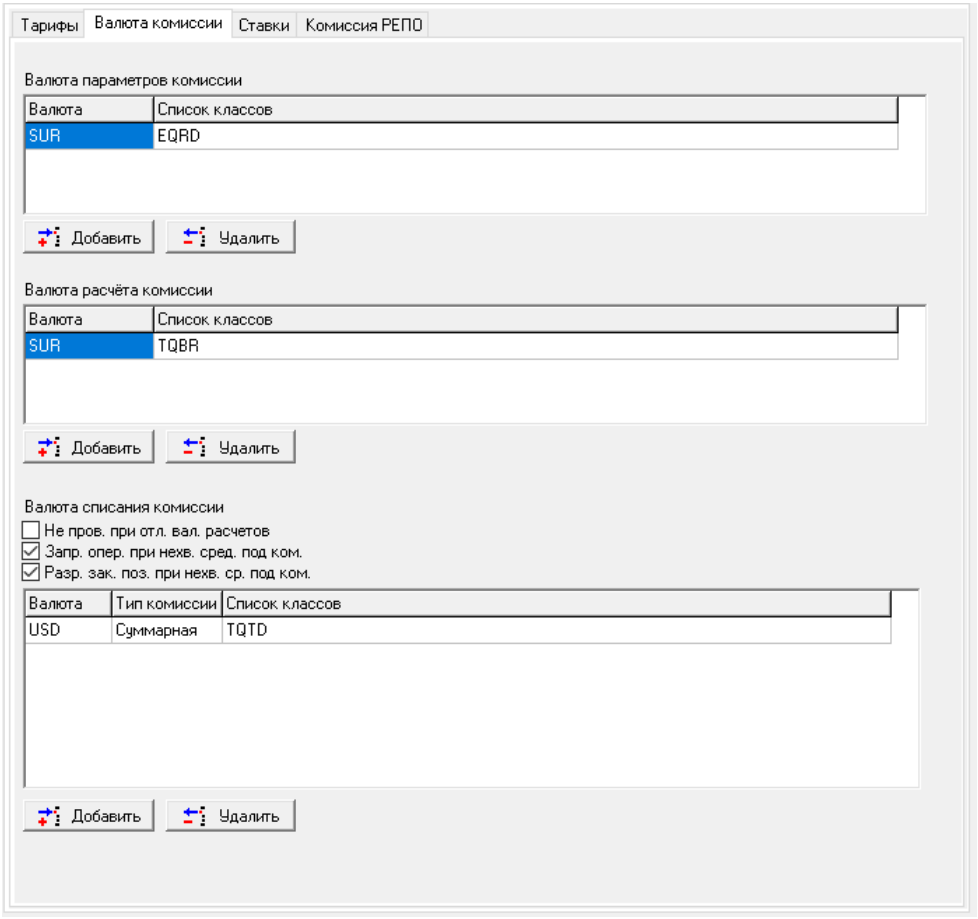
Один класс инструментов может быть включен только в одну группу инструментов в каждом тарифном плане. Для каждого тарифного плана группы инструментов формируются независимо.

Параметр	Назначение
Список классов	Список всех доступных классов инструментов для определения шкалы комиссии
Тип шкалы комиссии по классу:	Выбор применяемой шкалы комиссии для выбранного класса
_ Нулевая комиссия	Означает, что по данному классу начисляется нулевая комиссия
_ Шкала комиссии по умолчанию	Означает, что к данному классу применяется шкала комиссии, заданная по умолчанию (на странице «Общие параметры»)
_ Шкала комиссии группы <код группы>	Означает, что данный класс комиссии включен в группу <код группы> и к нему применяется шкала комиссии данной группы

6.1.2 Классы для учета оборота

Настройка «Классы для учета оборота» предназначена для указания через запятую классов, сделки в которых учитываются при определении торгового оборота для расчета комиссии по шкале, но не влияют на позиции. Необходимо убедиться, что указанные классы не добавлены в настройку «Классы без расчёта и контроля лимитов».

6.2 Валюта комиссии



6.2.1 Валюта параметров комиссии

Настройка «Валюта параметров комиссии» определяет валюту, в которой заданы настройки:

- «Комиссия от объема операции» – глобальный, шаблонный и индивидуальный варианты настройки (см. п. 6.3.1);
- Комиссия на сделки с голоса;
- Шкалы комиссии:
  - «Настройки комиссии брокера по умолчанию» (см. п. 4.7);
  - «Настройка шкал брокерской комиссии для классов» (см. п. 6.1.1);
  - «Настройка шкалы комиссии» в индивидуальных и шаблонных настройках комиссии (см. п. 10 и 14).

В полях таблицы должны быть указаны следующие параметры:

Параметр	Назначение
Валюта	Код валюты, в которой указана комиссия в перечисленных настройках
Список классов	Список классов через запятую, для которых указан код валюты параметров комиссии

6.2.2 Валюта расчёта комиссии

Настройка «Валюта расчёта комиссии» предназначена для указания кода валюты:

- комиссии, получаемой сервером QUIK из торговой системы – если включена опция «Использовать комиссию ТС» (см. п. 4.1);
- фиксированных сумм комиссии торговой системы (например: размер минимальной комиссии, размер комиссии за сделку), формируемых сервером самостоятельно – если отключена опция «Использовать комиссию ТС» (см. п. 4.1).

Если валюта, указанная в данной настройке, отличается от валюты расчёта комиссии, то комиссия торговой системы для указанных классов конвертируется в валюту расчёта.

Настройка не влияет на расчёты и учёт комиссии брокера.

В полях таблицы должны быть указаны следующие параметры:

Параметр	Назначение
Валюта	Код валюты, в которой сервер QUIK получает комиссию из торговой системы
Список классов	Список классов через запятую, для которых указан код валюты комиссии торговой системы

6.2.3 Валюта списания комиссии

Группа настроек «Валюта списания комиссии» предназначена для указания кода валюты, для которой производятся:

- проверка и блокировка по заявке;
- разблокировка и списание по сделке;
- расчет оборота при определении ставки комиссии по шкале (если для класса не задана настройка «Валюта параметров комиссии»).

Если валюта, указанная в данной группе настроек, отличается от валюты комиссии брокера и / или ТС, то комиссия брокера и / или ТС для указанных классов конвертируется в валюту списания по текущему кросс-курсу сервера QUIK. Комиссия при этом учитывается на том же теге расчётов, что и сама сделка.

> **По классам, заданным в настройке «Классы, для которых используется входящий кросс-курс», для конвертации комиссии в валюту списания используется входящий кросс-курс.**

Настройки используются для схем кредитования клиентов «по дисконтам», «МД+» и «по плечу». Если при использовании настройки «Вести денежные позиции в разрезе валют»

включена настройка «Валюта списания комиссии», то настройка «Валюта расчета комиссии» (см. п. 6.1.4) также должна быть включена.

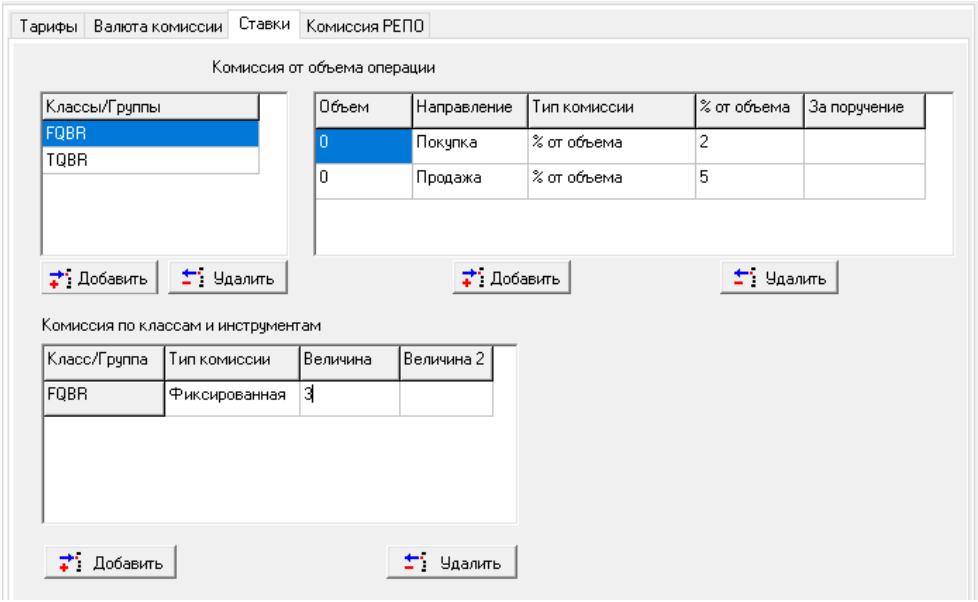
Следующие настройки имеют более высокий приоритет, чем настройка «Валюта списания комиссии»:

- «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции – при отсутствии лимитов;
- «Игнорировать проверку для адресных заявок».

Параметр	Назначение
Не пров. при отл. вал. расчетов	Не проверять достаточность средств под комиссию, если валюта списания комиссии отличается от валюты расчетов
Запр. опер. при нехв. сред. под ком.	Запрет операций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке запрещены все операции (в том числе закрытие позиций) по классам, перечисленным в списке, если объём комиссии превышает доступный остаток в указанной валюте списания комиссии. При закрытии позиций достаточность объёма под комиссию проверяется только на плановом виде лимита по указанной валюте. По умолчанию настройка выключена
Разр. зак. поз. при нехв. ср. под ком.	Разрешить закрытие позиций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке разрешены операции закрытия позиций при нехватке средств под комиссию. Настройка имеет смысл при включенной настройке «Запр. опер. при нехв. сред. под ком.». По умолчанию настройка выключена
_ * Валюта	Код валюты, в которой сервер QUIK списывает комиссию
_ * Тип комиссии	Тип комиссии. Возможные значения: _ «Суммарная» – комиссия брокера и торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового (акции, облигации) и валютного рынков; _ «ТС» – комиссия торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового рынка (акции, облигации)
_ * Список классов	Список классов через запятую, для которых указан код валюты комиссии

* – не допускается указание одного класса для разных валют и одного типа комиссии, а также дублирование сочетания кода валюты и типа комиссии в разных строках таблицы. Если класс указан одновременно для типов комиссии «ТС» и «Суммарная», то для комиссии брокера используется код валюты, указанный для типа комиссии «Суммарная».

6.3 Ставки



6.3.1 Комиссия от объема операции

Группа настроек «Комиссия от объема операции» предназначена для настройки ставок комиссии в зависимости от исполненного объема поручения и направления операции в разрезе классов. Настройка применяется для операций на фондовом рынке (акции, облигации), в том числе для операций РЕПО (денежный рынок).

Настройка имеет самый высокий приоритет среди всех глобальных настроек комиссии брокера.

Параметр	Назначение
Классы/Группы	Список классов/групп через запятую, для которых действуют ставки комиссии
Объем	Нижняя граница объема поручения, к которой применяется данная ставка комиссии, в валюте параметров комиссии (см. п. 6.2.1). Если настройка «Валюта параметров комиссии» для класса не задана, то значение объема интерпретируется в рублях. Для операций РЕПО комиссия рассчитывается исходя из объема первой части операции
Направление	Направление операции. Для операций РЕПО задается направление первой части. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа»; _ «Не задано» – комиссия применяется к операциям любого направления
Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Возможные значения: _ «% от объема» – процент от объема поручения;

Параметр	Назначение
	_ «Max (%; за поручение)» – используется большее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение; _ «Min (%; за поручение)» – используется меньшее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение
% от объема	Сумма комиссии вычисляется как процент от объема поручения
За поручение	Максимальная или минимальная (в зависимости от типа комиссии) сумма комиссии брокера по всем сделкам в рамках одного поручения

6.3.2 Комиссия по классам и инструментам

Тип комиссии брокера может быть задан для отдельных классов и групп инструментов. Комиссия на класс / группу имеет более высокий приоритет по сравнению с другими настройками комиссии брокера. Комиссия на класс РЕПО имеет более высокий приоритет по сравнению с комиссией РЕПО, задаваемой на странице «Общие параметры» (см. п. 4.7).

Чтобы задать комиссию на класс / группу, в секции «Комиссия по классам и инструментам» нажмите на кнопку «Добавить», в открывшемся окне выберите тип создаваемого элемента (класс или группа), выберите код класса / группы и нажмите кнопку «ОК». В таблице «Комиссия по классам и инструментам» появится строка с наименованием выбранного класса / группы. В полях таблицы должны быть указаны следующие параметры:

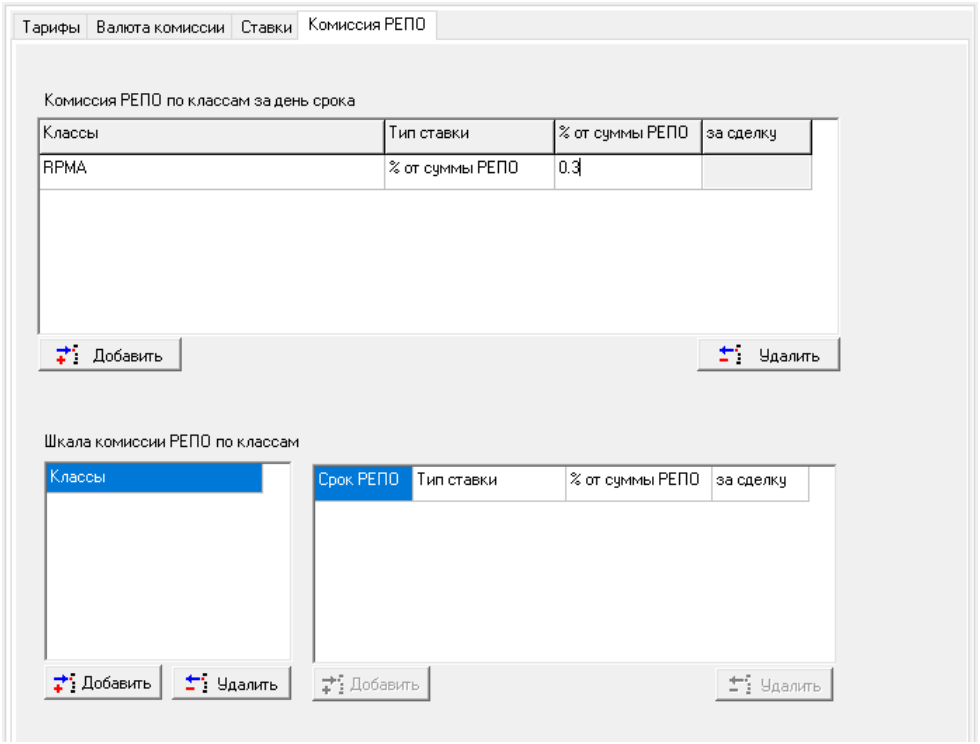
Параметр	Назначение
Класс/ Группа	Код класса или группы, для инструментов которых назначена комиссия
Тип комиссии	Способ указания комиссии. Описание типов комиссии см. в п. 10 «Клиенты» / «Комиссия брокера»
Величина	Величина брокерской комиссии. Для комиссий типа «Max» – величина брокерской комиссии за сделку. Единицы измерения зависят от выбранного типа комиссии
Величина 2	Для типа комиссии «Max(сдел., фикс.)» – фиксированная величина брокерской комиссии в процентах. Для типа комиссии «Max(сдел., штуку)» – величина брокерской комиссии за единицу инструмента в валюте расчета

Приоритет выбора ставки комиссии в порядке убывания в зависимости от значений, заданных на вкладке «Группы инструментов и классов» (см. п. 8.12):

1. Ставка комиссии для группы, в которую входят указанные коды класса и инструмента;

2. Ставка комиссии для группы, в которую входят все классы и указанные коды инструмента;
3. Ставка комиссии для группы, в которую входят указанные коды класса и все инструменты;
4. Ставка комиссии для группы, в которую входят все классы и инструменты;
5. Ставка комиссии, заданная на класс операции.

6.4 Комиссия РЕПО



> **Настройки имеют более высокий приоритет, чем все другие глобальные настройки брокерской комиссии РЕПО.**

Вкладка предназначена для настройки ставок комиссии РЕПО для разных классов.

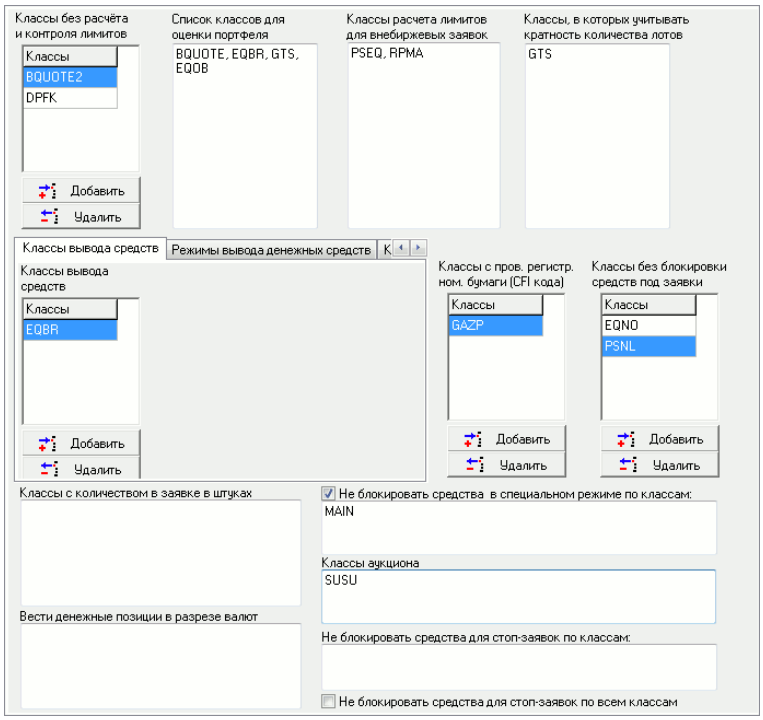
Параметр	Назначение
Комиссия РЕПО по классам за день срока	Ставки комиссии РЕПО за день срока в разрезе классов
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Настройка на конкретный класс приоритетнее, чем настройка на <ALL>
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения:

Параметр	Назначение
	_ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в процентах от суммы РЕПО за каждый день срока; _ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Обязательно для заполнения для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно. Значение по умолчанию «0» – не задано
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
Шкала комиссии РЕПО по классам	Шкала ставок комиссии РЕПО в разрезе классов. Настройка имеет более высокий приоритет, чем настройка «Комиссия РЕПО по классам за день срока»
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Обязательно для заполнения при добавлении строки. Дублирование кода класса не допускается
_ Срок РЕПО	Срок сделки РЕПО. Ставка применяется к сделкам, срок РЕПО которых больше или равен заданному количеству дней при отсутствии подходящей ставки с большим количеством дней. Срок РЕПО задается обязательно начиная с 0
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения: _ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в % от суммы РЕПО за каждый день срока; _ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку

Параметр	Назначение
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Доступно для редактирования для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно

7. Классы

Страница «Классы» предназначена для указания классов, по которым действуют особые правила контроля операций клиентов.



Параметр	Назначение
Классы без расчёта и контроля лимитов	Список классов инструментов, по которым не выполняются проверки достаточности средств для исполнения заявок клиентов. В списке могут быть указаны классы вывода средств. Для указанных классов настройки «Ограничения по классам инструментов» и «Ограничения по инструментам», заданные на странице «Ограничения на … / Цены заявок» (см. п. 20), игнорируются

Параметр	Назначение
Список классов для оценки портфеля	Список классов инструментов (через запятую), используемых для оценки активов клиентов и очередность их использования. Может применяться для установки приоритета какого-либо класса, если одни и те же инструменты торгуются в нескольких классах – приоритет классов в списке уменьшается слева направо. Данный список классов ограничивает отображение инструментов в таблице «Купить/продать» в Рабочем месте QUIK. Если параметр не задан, то используется список по умолчанию: «EQBR,EQNS,EQNL,EQBS,EQNE,EQNB,EQOB,EQOS,EQNO,EQLV,EQLI, EQOV,EQDE,EQGO,EQYO,EQEU,EQEO,TQBR,TQBS,TQLV,TQLI,TQNE, TQQI,TQNL,TQOB,TQCB,TQRD,TQIR,TQOS,TQNO,TQOV,TQNB,TQUS, TQEU,TQDE,TQPI,TQIF,TQTF,TQBD,TQFD,TQFE,TQPD,TQPE,TQTD, TQTE,TQOD,TQOE,TQOY,TQUD,TQED,TQIU,TQIE,TQIY,TQDD,TQQD, FQBR,FQDE,MAIN,GAZ,GTS,SPBSPT,SPBFUT,SPBOPT,CETS,SDBP». Параметр имеет меньший приоритет, чем параметр «Список классов для оценки портфеля», заданный в индивидуальных настройках на странице «Клиенты / Настройки "плеча"» (см. п. 13) или в шаблонных на странице «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"» (см. п. 15)
Классы расчета лимитов для внебиржевых заявок	Список классов инструментов (через запятую), по которым осуществляется проверка достаточности средств при подаче заявок РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S*» и «B*»). Проверка осуществляется при включенном флажке «Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок» (см. п. 4.3). Если список классов не задан, проверка достаточности средств выполняется по всем классам
Классы, в которых учитывать кратность количества лотов	Список классов, по которым необходимо учитывать параметр «Кратность лота» Таблицы текущих торгов. Если параметр «Кратность лота» для указанных классов отличается от 1, то это учитывается при округлении объёма заявки и комиссий брокера и торговой системы. Кроме того, для указанных классов Библиотека расчётов лимитов контролирует, чтобы количество лотов, указанное в заявке, было кратно значению параметра «Кратность лота»
Вкладка «Классы вывода средств»	
Классы вывода средств	Операции по перечисленным в этом разделе классам не приводят к увеличению текущих остатков средств клиента по деньгам (при продаже) и бумагам (при покупке). Такой режим обсчёта лимитов может использоваться, например, при сделках с отложенной поставкой – под сделку покупки деньги со счёта блокируются в текущую торговую сессию, но бумаги в текущую торговую сессию не зачисляются, так как поставка будет произведена через некоторое количество дней.

Параметр	Назначение
	Операции по этим классам ведутся в строгом соответствии с маржинальными настройками. Поэтому при маржинальных сделках может образовываться задолженность, так как актив не будет начислен клиенту, а удержится на этом классе, что может привести к падению уровня маржи ниже ограничительного. Настройка не распространяется на клиентов, которым список классов задан индивидуально
Вкладка «Режимы вывода денежных средств»	
Режимы вывода денежных средств	Для классов из этой секции бумаги по сделкам покупки на счёт – зачисляются, не зачисляются только денежные средства по сделкам продажи. Если один и тот же класс указан в «Классах вывода средств» и «Режимах вывода денежных средств», то более приоритетным считается режим «Классы вывода средств». Операции по этим классам, аналогично режиму «Классы вывода средств», ведутся в соответствии с маржинальными настройками. Настройка не распространяется на клиентов, которым список классов задан индивидуально
Вкладка «Классы запрета рын. заявок на прод.»	
Классы запрета рыночных заявок на продажу	Список классов, по которым запрещено выставлять в торговую систему рыночные заявки на продажу. При попытке подачи заявки будет выведено сообщение «Рыночная заявка на продажу по инструменту <код инструмента> в классе <код класса> запрещена». Клиент может покупать ценные бумаги, или выставлять рыночные заявки на продажу без указания клиентского кода. Настройка не распространяется на период закрытия, где допускается ввод только рыночных заявок. Приоритет настроек «Классы запрета рыночных заявок на продажу», «Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт» и «Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт» см. в Комментарии
Вкладка «Классы запр. рын. заяв. на пр. в шорт»	
Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт	Список классов и инструментов, по которым клиентам запрещено выставлять в торговую систему рыночные заявки на продажу, приводящие к образованию отрицательного остатка по инструменту. При попытке подачи такой заявки выводится сообщение «Рыночная заявка на продажу в шорт по инструменту <код инструмента> в классе <код класса> запрещена». Клиент может покупать ценные бумаги, или выставлять рыночные заявки на продажу с указанием клиентского кода, если они не приводят к образованию шорта. Запрет устанавливается на все инструменты определенного класса либо на список инструментов. Настройка игнорируется в следующих случаях:

Параметр	Назначение
	_ Выставление заявки во время периода закрытия торговой сессии, где допускается ввод только рыночных заявок; _ Подача заявки без указания кода клиента; _ Подача заявки по классу, указанному в настройке «Классы без расчёта и контроля лимитов». Приоритет настроек «Классы запрета рыночных заявок на продажу», «Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт» и «Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт» см. в Комментарии
Вкладка «Классы разр. рын. заяв. на пр. в шорт»	
Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт	Список классов и инструментов, по которым клиентам разрешено выставлять в торговую систему рыночные заявки на продажу, приводящие к образованию отрицательного остатка по инструменту. Разрешение устанавливается на все инструменты определенного класса либо на список инструментов. Настройка игнорируется в следующих случаях: _ Выставление заявки во время периода закрытия торговой сессии, где допускается ввод только рыночных заявок; _ Подача заявки без указания кода клиента; _ Подача заявки по классу, указанному в настройке «Классы без расчёта и контроля лимитов». Приоритет настроек «Классы запрета рыночных заявок на продажу», «Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт» и «Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт» см. в Комментарии
Вкладка «Огр. макс. кол. в заяв.»	
Ограничение максимального количества в заявке	Контроль максимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. При проверке игнорируется опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в настройке из шаблона (см. п. 16), то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в данной настройке.
_ Классы	Список классов бумаг, для которых задается максимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиента. Для обозначения всех классов укажите <ALL>

Параметр	Назначение
_ Количество	Максимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, больше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то ограничения нет
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение максимального количества в заявке действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение максимального количества в заявке. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Огр. мин. кол. в заяв.»	
Ограничение минимального количества в заявке	Контроль минимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. При проверке игнорируется опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в настройке из шаблона (см. п. 16), то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в данной настройке.
_ Классы	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиента. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Количество	Минимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, меньше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то используется значение параметра «Минимальное кол-во» из Таблицы текущих торгов инструмента заявки. Если значение отсутствует и в Таблице текущих торгов, то ограничения нет
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение минимального количества в заявке действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение минимального количества в заявке.

Параметр	Назначение
	Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Классы с контр. мин. об. в заявках»	
Ограничения на минимальный объем заявок по классам	Контроль минимально допустимого объема заявки по заданному классу инструментов. Заявки по данному классу с объемом, меньше заданного, отвергаются при проверке покупательной способности. Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в настройке из шаблона (см. п. 16), то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в данной настройке.
_ Классы	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимый объем заявки. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Объем	Минимальный объем одной заявки клиента, выраженный в валюте расчетов
_ Валюта	Валюта, в которой задается ограничение минимального объема в заявках. Значение допустимого объема заявки рассчитывается в заданной валюте, и, если валюта расчетов отличается от заданной, ограничение пересчитывается согласно кросс-курсу. Если валюта не задана, то значение ограничения рассчитывается в валюте расчетов без конвертации
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение минимального объема в заявке действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение минимального объема в заявке. Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Классы без использ. ком. ТС»	
Классы без использования комиссии ТС	Список классов бумаг, на которые не распространяется глобальная настройка «Использовать комиссию ТС» (описание приведено в разделе Общие параметры/ Общие настройки библиотеки. Часть 1)
Вкладка «Классы с игн. огр. на мин. раз. ком. ТС»	

Параметр	Назначение
Классы с игнорированием ограничений на минимальный размер комиссии ТС	Список классов инструментов, для которых минимальный размер комиссии торговой системы игнорируется. В списке обязательно указываются классы, у которых комиссии «за ИТС», «За организацию торговли», «Клиринговая» (указанных в секции «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов») отличаются от комиссий принятых на рынках
Вкладка «Классы, для кот. игн. тип лим.»	
Классы, для которых игнорируется тип лимитирования на открытую позицию с расчетом лимита от оборота с возмещением	Список классов и инструментов, для которых схема лимитирования на открытую позицию с расчетом лимита от оборота с возмещением не действует (подробнее о настройках схем кредитования см. п. 23 «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования»). Настраивается по следующему правилу: В список классов добавляется новый класс. В правом окне через запятую указывается список используемых инструментов для выбранного класса, либо выбирается значение «Все бумаги класса»
Вкладка «Классы с игн. пр. обяз. по вид. лим.»	
Классы с игнорированием проверки обязательств по видам лимитов	Список классов, для которых вид лимита игнорируется. То есть проверка, блокировка и списание средств производится только на лимитах операции. Например, если класс INSTR привязан к виду лимита Т0, а проверка обязательств по видам лимитов настроена для Т0, Т1, Т2, то после добавления класса INSTR в список классов, для которых вид лимита игнорируется, проверка, блокировка и списание лимитов будет осуществляться только по виду лимита Т0
Вкладка «Прив. кодов расч. к кл. и вид. лим.»	
Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов	Настройка соответствия кодов расчетов виду лимита и классам. В полях «Коды расчетов» и «Классы» допускается указывать через запятую несколько кодов расчетов и классов соответственно. Одна и та же пара значений «Код расчетов»-«Класс» не может быть поставлена в соответствие разным видам лимита. Настройка используется только для адресных режимов торгов и режимов РЕПО с ЦК. Настройка используется в таких режимах торгов, когда заявки выставляются с указанием нескольких кодов расчетов, а проверка, блокировка и списание средств по этим заявкам осуществляется на тех видах лимитов, к которым привязаны указанные коды расчетов. Например, рассмотрим случай, когда в режиме торгов РЕПО с ЦК настроено соответствие класса PTEQ кодам расчетов Y1 и Y2 и виду лимита Т2. Тогда операции по классу PTEQ с кодом расчетов Y2 учитываются на виде лимите Т2. А вид лимита для операций по тому же классу и коду расчетов S0 определяется настройкой «Привязка

Параметр	Назначение
	классов к видам лимитов». Данная настройка не передается на Рабочее место QUIK и используется только для настройки операций РЕПО. Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13
Вкладка «Кл, в кот. запр. выст. ст.-заяв.»	
Классы, в которых запрещено выставление стоп-заявок	Список классов инструментов, по которым запрещено выставление стоп-заявок. Настройка проверяется также для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции
Вкладка «Классы вал. рынка со спис. ком. с увелич. лим.»	
Классы валютного рынка со списанием комиссии с увеличивающегося лимита	Список классов, в которых блокировка и списание комиссии по конверсионным операциям с валютой осуществляется с того денежного лимита, на который поступают средства в результате исполнения обязательств по заключенной сделке. Под комиссией понимается сумма комиссии брокера и комиссии торговой системы в случае ее расчета сервером QUIK (при отключенной опции «Использовать комиссию ТС»). Настройка используется только для классов с признаком «Валютный рынок» при использовании денежной валютной схемы. Настройка работает только с типами комиссии «Фиксированная комиссия» и «Max(сдел., фикс.)» и не работает со шкалой комиссии
Вкладка «Классы с маркировкой тран. по агрег. поз.»	
Классы с маркировкой транзакций по агрегированной позиции	Список классов, по которым необходимо маркировать все транзакции подачи заявок на покупку и продажу. При подаче заявки транзакция маркируется признаком, указывающим на то, открывает ли данная заявка новую позицию или закрывает существующую с учетом знака позиции. Если клиент является субклиентом какого-либо субброкера, то при маркировке анализируется позиция головного субброкера, к которому относится клиент, выставляющий заявку. Если клиент не является субклиентом какого-либо субброкера, то при маркировке анализируется позиция данного клиента. Если список не содержит ни одного класса, маркировать транзакции не требуется ни по одному из классов. Настройка используется только для фондового и срочного рынков
Вкладка «Доп. классы для оценки портфеля»	
Дополнительные классы для оценки портфеля	Параметр позволяет дополнить список классов для оценки портфеля, не переопределяя список классов по умолчанию (параметр «Список классов для оценки портфеля» не задан), или

Параметр	Назначение
	дополнить собственный список классов, если параметр «Список классов для оценки портфеля» переопределен. Значение параметра не учитывается, если задан параметр «Список классов для оценки портфеля» в индивидуальных настройках на странице «Клиенты / Настройки "плеча"» (см. п. 13) или в шаблонных на странице «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"» (см. п. 15)
Вкладка «Классы, для кот. исп. вход. кросс-курс»	
Классы, для которых используется входящий кросс-курс	Список классов через запятую, для которых во всех расчетах с использованием кросс-курсов валют используется входящий кросс-курс (цена закрытия для соответствующей валюты в Таблице текущих торгов). Во всех остальных режимах по умолчанию используется текущий кросс-курс
Вкладка «% доп. рез. при рын. заяв в раз кл»	
% доп. резервиров. при рыночн. заявке в разрезе классов	Процент дополнительного резервирования при рыночной заявке, заданный для определенного класса. Настройка имеет больший приоритет, чем настройка «% доп. резервиров. при рыночн. заявке»
Вкладка «Классы без частичного исполнения»	
Классы без частичного исполнения	Список классов, для которых комиссия и объем, рассчитанные для целей претрейд-проверки и блокировки, округляются исходя из всего объема заявки, а не для каждого лота. Включение настройки отключает механизм резервирования дополнительных средств под комиссию на каждый лот заявки. Поэтому при включённой настройке и исполнении заявки несколькими сделками не гарантируется контроль ухода клиентского счета в минус на величину комиссии
Вкладка «Классы со списанием средств в Т0»	
Классы со списанием средств в Т0	Настройка используется для операций, которые учитываются на видах лимита, отличных от Т0. Если класс операции указан в настройке, то по сделкам, совершаемым клиентом с инструментами этого класса, блокировка и списание активов дополнительно производятся на всех предыдущих видах лимита, начиная с Т0. Зачисление активов на дополнительные виды лимита при этом не производится. Например, на видах лимита, предшествующих тем, где учитываются операции, для сделок покупки производится только списание денежных средств с позиции по деньгам (без учета комиссий брокера и торговой системы), а для сделок продажи – только списание количества в сделке с позиции по инструменту.

Параметр	Назначение
	Допускается указывать только классы спот- и РПС-операций на фондовом рынке. Настройку нельзя использовать совместно с настройкой «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов», если предполагается совершение операций с расчетами в Т0
Вкладка «Экспорт цен для рын. заявок»	
Классы экспорта цен для оценки рыночных заявок	Список классов, по которым при претрейд-проверке заявок используется цена инструмента в первом найденном классе из списка классов, формируемого параметрами «Список классов для оценки портфеля» и «Дополнительные классы для оценки портфеля». Порядок определения цены: _ цена лучшего спроса и предложения; _ цена последней сделки; _ цена закрытия
Вкладка «Классы OMS с авт. рекальк.»	
Классы OMS с автоматической рекалькуляцией	Список классов OMS, в которых применяется автоматическая рекалькуляция позиций для случаев, когда происходит изменение ключевых параметров OMS-заявки, а также когда происходит отмена сделки или переход OMS-заявки из терминального статуса («Снята» / «Исполнена») в любой другой статус. При настроенной субброкерской схеме для операций OMS данная настройка не работает
Вкладка «Классы без уч. отсроч. сделок»	
Классы без учета отсроченных сделок для исполнения	Классы инструментов, для которых не требуется учитывать на позициях клиентов отсроченные сделки для исполнения в режимах РПС и РПС с ЦК, а также сделки для исполнения по вторым частям РЕПО и РЕПО с ЦК. При подаче отчета по такой сделке средства не блокируются, а при ее исполнении – сделка не рассчитывается. Под отсроченной сделкой для исполнения РПС и РПС с ЦК понимается сделка для исполнения, которая исполняется в день Т+1 или позже после заключения самой адресной сделки. Во избежание некорректного лимитирования операций не допускается одновременно включать в сложный отчет сделки для исполнения из классов, указанных и отсутствующих в данной настройке
Вкладка «Округление НКД в РЕПО-М»	
Классы РЕПО-М с округлением суммарного НКД	Список кодов классов, в которых округление НКД при лимитировании операций РЕПО-М выполняется не на каждый инструмент, а на весь объем
Вкладка «Учет операций РЕПО»	

Параметр	Назначение
Классы адресного РЕПО с учетом второй части по сделке	Список классов РЕПО-М и адресного РЕПО с ЦК, для которых по заявке и сделке на позициях клиента, по сроку расчетов соответствующих второй части, учитываются комиссия и разница между суммой выкупа РЕПО и суммой РЕПО. Используемые сроки расчетов (виды лимита) должны покрывать обе части сделки. Не поддерживается возможность отказа от исполнения сделки РЕПО: в случае отказа от исполнения брокеру необходимо скорректировать лимиты. Настройка отменяет действие настроек «Игнорировать срок расчетов РЕПО с ЦК» и «Рассчитывать обязательства РЕПО/РПС по всем видам лимитов»
Другие настройки	
Классы с проверкой регистрационного номера бумаги (CFI кода)	Список классов бумаг, по которым осуществляется проверка допустимости CFI кода. Настройка не распространяется на клиентов, которым список классов задан индивидуально. Настройка не учитывается для операций закрытия позиций
Классы без блокировки средств под заявки	Список классов бумаг, при торговле которыми будут применены следующие правила: _ при подаче заявки осуществляется только проверка соответствия параметров заявки ограничениям (на цену, объем и т.д.), проверка покупательной способности клиента не производится; _ не блокируются средства под заявку; _ при регистрации сделки производится безусловное начисление/списание средств. Настройка «Классы без расчёта и контроля лимитов» имеет более высокий приоритет по сравнению с данной настройкой
Классы с количеством в заявке в штуках	Список классов Модуля неторговых поручений, по которым количество бумаг в поручениях должно указываться в штуках, а не в лотах. Коды классов в списке разделяются запятыми. Данная настройка доступна только при отключенном параметре «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3)
Вести денежные позиции в разрезе валют	Список классов, в которых торгуются валютные пары. По инструментам из этих классов не устанавливаются и не ведутся лимиты по бумагам. При регистрации сделок с валютными парами в QUIK меняются только денежные позиции по соответствующим валютам. Код инструмента включает следующие поля: [базовая валюта][валюта котировки][период расчета] Например, для инструмента EURRUR_TOD базовой валютой будет EUR, валютой котировки RUR, а периодом расчёта TOD.

Параметр	Назначение
	При заключении сделки денежные лимиты будут модифицироваться следующим образом: _ При продаже валютной пары: _ уменьшается позиция по базовой валюте сделки на сумму сделки (количество лотов * размер лота); _ увеличивается позиция по валюте котировки на количество лотов*цена одного лота * размер лота. _ При покупке валютной пары: _ увеличивается позиция по базовой валюте сделки на сумму сделки (количество лотов * размер лота); _ уменьшается позиция по валюте котировки на количество лотов*цена одного лота * размер лота По умолчанию значение настройки – пусто. При использовании схемы кредитования клиентов «по дисконтам» или «МД+» для корректной работы функционала ведения денежных позиций в разрезе валют также необходимо указать значения дисконтов на используемые валюты в настройках вида «Список дисконтов по бумагам». Используемые валюты должны быть объединены в рамках настройки «Доп. теги расчетов» / «Дополнительные валюты»
Не блокировать средства в специальном режиме по классам	Список классов бумаг, по которым не осуществляется блокировка средств под исполнение заявок, отправленных в специальном режиме торгов Московской Биржи (значение параметра «код расчетов по умолчанию» отлично от «Т0»). Настройка применяется, если флажок включен. Если флажок снят, то список классов сохраняется, но не применяется
Классы аукциона	Список классов (через запятую), в которых проводятся аукционы первичного размещения. Если условиями аукциона предусмотрено формирование сделок для исполнения, то их учет зависит от кода расчетов: _ сделки для исполнения с кодом расчетов, соответствующим дате аукциона (В0), не учитываются на позиции клиента; _ сделки для исполнения с кодом расчетов, соответствующим более поздней дате (В01 … В0x), учитываются в соответствии с настройками «Классы без учета отсроченных сделок для исполнения» и «Рассчитывать обязательства РЕПО/РПС по всем видам лимитов»
Не блокировать средства для стоп-заявок по классам	Список классов бумаг через запятую, по которым не осуществляется блокировка средств при выставлении стоп-заявок. Настройка применяется для всех классов, если установлен флажок «Не блокировать средства для стоп-заявок для всех классов».

Параметр	Назначение
	Настройка не должна использоваться совместно с настройкой calclimit_old_stoporders файла quik.ini (подробнее см. в Руководстве по администрированию «Инструкция по установке Сервера QUIK»)

Настройки «Классы запрета рыночных заявок на продажу», «Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт» и «Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт» имеют следующий приоритет (в порядке уменьшения):

1. «Классы запрета рыночных заявок на продажу».
2. «Классы запрета рыночных заявок на продажу в шорт».
3. «Классы разрешения рыночных заявок на продажу в шорт».

8. Инструменты

Страница «Инструменты» предназначена для настройки зависимостей между инструментами на разных рынках, используемой для расчета покупательной способности, а также соответствия инструмента и вида лимита.

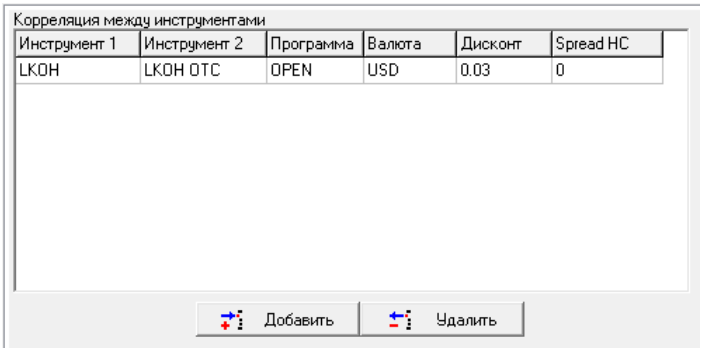
8.1 Корреляция между инструментами

Использование настроек включается признаком «Использовать корреляцию между инструментами» на странице **Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования** (см. п. 23).

Для примера рассмотрим ситуацию, когда у клиента есть позиция по инструменту, например «Лукойл», на Московской Бирже и позиция на западной площадке (ADR). С точки зрения QUIK это две разные позиции по разным инструментам (по разным рынкам), хотя, по сути, ценная бумага одна. Однако их нельзя рассматривать как равнозначные по стоимости инструменты (имеют место такие риски, как волатильность, стоимость конвертации и т.п.), то есть необходимо учитывать некоторый коэффициент корреляции между «локальной» бумагой (LOCAL) и ADR.

В такой ситуации настройка позволяет при расчёте покупательной способности клиента покрыть (частично или полностью) его задолженность (короткую позицию по одной бумаге) за счёт имеющейся длинной позиции по второй бумаге. При этом, корректируется оценка короткой позиции по первому инструменту (уменьшая задолженность клиента), и одновременно также корректируется оценка длинной позиции по второму инструменту (её оценка тоже уменьшается). Настройки в данной секции позволяют ввести зависимость между парами инструментов и указать для каждой пары коэффициенты дисконтирования

(используется при конвертации в валюту расчётов) и корреляции (используется при переоценке стоимости позиций).



Параметр	Назначение
Инструмент1	Код ценной бумаги, для которой будет дисконтироваться оценка короткой позиции
Инструмент2	Код ценной бумаги, за счёт уменьшения оценки стоимости длинной позиции, по которой производится корректировка. Допускается добавление кода бумаги не более одного раза в колонки «Инструмент1» и «Инструмент2»
Программа	Признак, показывающий учитывается ли корреляция по данной паре инструментов при расчёте покупательной способности клиента. Возможные значения: «OPEN» – включено, оценка позиций по паре инструментов производится с учётом корреляции между ними, или «CLOSE» – выключено, для данной пары инструментов настройка не используется
Валюта	Валюта расчётов – валюта, в которой выражается оценка бумаг для корреляции. При отличии валюты одного или двух инструментов от валюты расчетов, оценка бумаг конвертируется в валюту расчетов, согласно настройкам кросс-курсов и дополнительно дисконтируется
Дисконт	Коэффициент дисконтирования при конвертации стоимости бумаг в валюту расчётов. Указывается в относительных единицах, долях целого. Например, значение дисконта 0.03 говорит о необходимости уменьшить оценку бумаги при ее конвертации в валюту расчетов на 3%. Дисконт не применяется при совпадении валюты бумаги и валюты расчетов. По умолчанию – «0»
*Spread HC	Коэффициент корреляции между инструментами. Показывает долю скорректированного объема короткой позиции по «Инструменту1» (спрэд), которая остается в оценке короткой позиции после корреляции. Данный механизм хэджирует риск изменений рыночных цен бумаг корреляции. Указывается в относительных единицах, долях целого. Например, при значении коэффициента корреляции 0.1, объем спрэда дисконтируется до 10% от первоначального. По умолчанию – «0»

* – если учитываются бумажные позиции с разных торговых счетов, то до вычисления корреляции предварительно суммируются позиции по инструментам, входящим в корреляцию (то есть корреляция по агрегированным бумажным позициям). Суммирование производится только для однонаправленных позиций (вначале суммируется количество бумаг, формируется суммарная позиция, а потом вычисляется ее оценка).

Параметры для расчета покупательной способности:

- **Short*** – дисконтированная оценка короткой позиции по Инструменту 1, скорректированная в результате «схлопывания» разнонаправленных позиций по связанным бумагам, где значение параметра **Short*** меньше, либо равно 0;
- **Long*** – дисконтированная оценка длинной позиции по Инструменту 2, скорректированная в результате «схлопывания» разнонаправленных позиций по связанным бумагам, где значение параметра **Long*** больше, либо равно 0;
- **(1-HC) и (1+HC)** – соответственно, коэффициенты «лонг» и «шорт», задаваемые на бумагу в списке коэффициентов по бумагам (см. п.21);
- $\mathbf{B_I}$ – цена спроса по I-ой ценной бумаге (лучший бид), пересчитанная в валюту расчётов;
- $\mathbf{S_I}$ – цена предложения по I-ой ценной бумаге (лучший аск), пересчитанная в валюту расчётов;
- $\mathbf{A_I}$ – текущая позиция по I-ой ценной бумаге (может быть отрицательной).

Алгоритм расчета позиции с использованием зависимости между инструментами:

Если у клиента имеется короткая позиция по некоторому инструменту **A1**, то при расчете покупательной способности добавляется следующая проверка:

1. В парах взаимосвязанных инструментов производится поиск инструмента A1, среди инструментов из колонки «Инструмент 1». Допустим, для A1 найдена пара, парный инструмент A2.
2. Если для найденной пары значение параметра «Программа» равно «OPEN» (то есть, учёт корреляции требуется производить), то в портфеле клиента ищется ДЛИННАЯ позиция по связанному инструменту A2.
   Поиск позиции по связанному инструменту A2 осуществляется среди всех позиций клиента. Независимо от торгового счета, на котором учитывается позиция, поиск производится по ВСЕМ торговым счетам, где у клиента есть позиции.
3. Если длинная позиция по инструменту A2 найдена, то проверяем, какая позиция больше по модулю: короткая по инструменту A1 или длинная по инструменту A2.
4. Если |Long инстр. A2| < | Short инстр.A1|, то позиции следует скорректировать следующим образом:

   $$\mathbf{Short^*_{инстр.A1} = -(|(Long_{инстр.\ A2} + Short_{инстр.A1}) * (1+HC)_{инстр.A1}| + Long_{инстр.\ A2} * SpreadHC) * (1+HC)_{инстр.A1}}$$

   $$\mathbf{Long^*_{инстр.\ A2} = 0}$$

   здесь: $\mathbf{(1+HC)_{инстр.A1}}$ – коэффициент «шорт» для инструмента A1 (Инструмент1 из настроек).
5. Если |Long инстр. A2| >= | Short инстр.A1|, то позиции следует скорректировать следующим образом:

Short *$_{\text{инстр.A1}}$= Short $_{\text{инстр.A1}}$ * SpreadHC* (1+HC)$_{\text{инстр.A1}}$

Long* $_{\text{инстр. A2}}$ =(Long $_{\text{инстр. A2}}$ + Short $_{\text{инстр.A1}}$) * (1-HC)$_{\text{инстр.A2}}$

здесь: **(1-HC) $_{\text{инстр.A2}}$** – коэффициент «лонг» для «инстр.А2» (Инструмент2 из настроек).

Оценки позиций по инструментам А1 и А2 рассчитываются в валюте расчётов, с учетом дисконта за конвертацию (**ConvDiscount**):

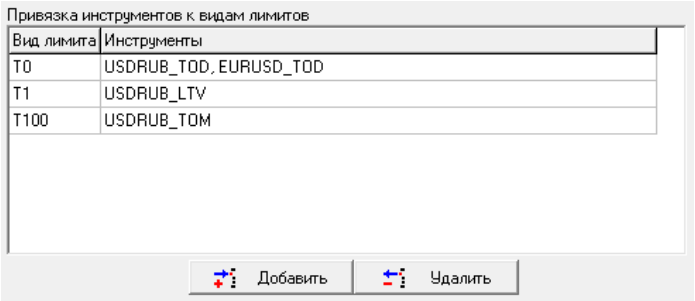
Long $_{\text{инстр. A2}}$ = positive(A $_{\text{инстр. A2}}$) * B $_{\text{инстр. A2}}$ / (1 + ConvDiscount)

Short $_{\text{инстр.A1}}$ = negative(A $_{\text{инстр.A1}}$) * S$_{\text{инстр.A1}}$ * (1 + ConvDiscount)

8.2 Привязка инструментов к видам лимитов

Настройка «Привязка инструментов к видам лимитов» позволяет задавать соответствие инструмента и вида лимита, начиная с которого отражается операция.

Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13.



Параметр	Назначение
*Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа Т, за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания
Инструменты	Перечень инструментов через запятую

* – если в колонке «Вид лимита» в качестве значения использована пустая строка или вид лимита, который не задан настройкой «Проверять обязательства по видам лимитов», при сохранении нажатием кнопки «Принять» выдается соответствующее предупреждение; сохранение и закрытие окна редактора отменяется. Если не заданы инструменты, строка сохраняется.

8.3 Инструменты с ограничением доли в обеспечении

Настройка задает список инструментов, суммарная оценка длинных позиций по которым не может превышать стоимости портфеля клиента.

Настройка используется для схем кредитования клиентов «по дисконтам» и «МД+».

Если инструмент заявки входит в список бумаг настройки, то по всем бумагам, входящим в данный список, вычисляется суммарная оценка всех позиций и активных заявок, которая сравнивается со стоимостью портфеля клиента.

В расчётах не участвуют бумаги из списка, для которых дисконты не определены. Сама заявка, инициализирующая проверку, в расчётах учитывается.

$$\sum_{i=\text{обесп.}} (Max(Pos_Depo_i * Last_i; 0) + \sum_{n,i} (Order_Long_i^n * Price_n)) > S$$

где:

- **S** – стоимость портфеля клиента.
- **i** – порядковый номер инструмента в списке бумаг.
- **Pos_Depo_i** – плановая позиция по i-му инструменту.
- **$Last_i$** – цена последней сделки по i-му инструменту; если нет – цена закрытия предыдущего дня.
- **n** – порядковый номер активной заявки на увеличение длинной позиции по i-му инструменту.
- **$Order_Long_i^n$**– количество в n-ой заявке на открытие/увеличение длинной позиции по i-му инструменту. Если заявка одновременно закрывает короткую позицию и открывает

длинную (переворот позиции из Short в Long), то учитывается только часть заявки, открывающая длинную позицию.

- **Price$_n$** – цена n-ой заявки:
  - для лимитированной заявки – цена, указанная в заявке;
  - для рыночной заявки – цена рыночной заявки в зависимости от торгового периода с применением процента дополнительного резервирования.

Если суммарная оценка всех позиций и активных заявок больше стоимости портфеля (неравенство выполняется), то заявка отклоняется с диагностикой «Превышен общий лимит бумаг обеспечения», дальнейшие проверки не производятся.

8.4 Инструменты с контролем минимального количества в заявках в интервал времени

Настройка «Инструменты с контролем минимального количества в заявках в интервал времени» позволяет контролировать минимально допустимое количество лотов в заявке на инструмент в интервал времени.

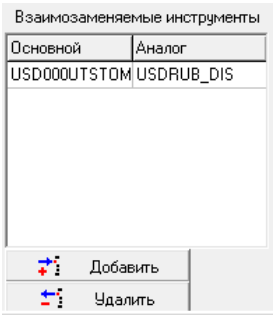
Параметр	Назначение
Класс	Класс инструментов, по которым задается ограничение. Поле обязательно для заполнения
Инструменты	Перечень инструментов через запятую. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>. Поле обязательно для заполнения
Количество в заявке	Минимальное количество лотов в заявке. Поле обязательно для заполнения
Интервал	Время в секундах, в течение которого подсчитываются заявки с количеством лотов меньше контрольного значения, указанного в поле «Количество в заявке». Поле необязательно для заполнения
Количество заявок	Максимальное количество заявок в указанном интервале времени. Поле необязательно для заполнения

> **Данная настройка применяется только при проверке покупательной способности по транзакциям и заявкам, поданным с помощью решений прямого доступа с пре-трейд контролем операций, таких как FIX2MICEX, FIX2LSE,**

> **MICEXPreTrade и т.п. В проверке покупательной способности по транзакциям и заявкам, поданным через сервер QUIK, настройка не участвует.**

8.5 Взаимозаменяемые инструменты

Настройка задает соответствия между основными инструментами и их аналогами. Инструменты-аналоги предназначены для выставления заявок, а основной инструмент используется для расчета лимитов. Для одного кода основного инструмента можно указать несколько кодов инструментов-аналогов через запятую.



Условия использования настройки:

1. Настройка используется только для схем кредитования клиентов «по дисконтам», «МД+» и «по плечу».
2. Настройка используется только для инструментов с одинаковой лотностью.

> **Требование одинаковой лотности не распространяется на инструменты режимов фиксинга и с использованием средневзвешенного курса на валютном рынке Московской Биржи.**

3. Для работы настройки обязательно наличие основного инструмента в классе выставления заявки по инструменту-аналогу.
4. Для взаимозаменяемых инструментов должны быть заданы одинаковые значения следующих настроек (если для основного инструмента эти настройки используются):
   - «Привязка инструментов к видам лимитов».
   - «Теги, определяемые по коду инструмента».
   - Настройки списков маржинальных бумаг, бумаг обеспечения и запрета коротких позиций.
   - Заданные коэффициенты.
   - Заданные дисконты.

Все операции по инструменту-аналогу учитываются на лимите основного инструмента:

- При подаче заявки по инструменту-аналогу проверки и блокировки производятся по лимиту основного инструмента.

- При расчете скорректированной маржи для клиентов «МД» используются ценовые параметры основного инструмента.
- При проверке заявок для клиентов «МП» используются ценовые параметры основного инструмента.
- При проверке заявок по основному инструменту или по инструменту-аналогу текущий остаток равен остатку по основному инструменту. Активные заявки по инструменту-аналогу считаются заявками по основному инструменту. Также заявки по инструменту-аналогу влияют на определение минимальной и максимальной цен основного инструмента для клиентов «МД».
- Сделки по инструменту-аналогу учитываются на лимитах по основному инструменту.

Объем заявки, содержащий дробные части разменных единиц (например, копеек) округляется по математическим правилам до целых разменных единиц.

При определении размера комиссии используется объем, полученный после округления.

> **Ограничения, заданные на основной инструмент, не распространяются на инструмент-аналог, и наоборот.**

Пример валютного фиксинга Московской биржи:

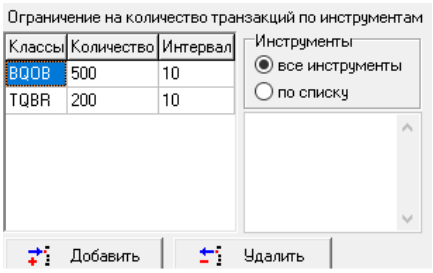
1. Заявка по инструменту-аналогу проверяется и блокируется на лимитах основного инструмента;
2. В результате исполнения заявки генерируются две сделки:
   - сделка по основному инструменту – учитывается при лимитировании;
   - сделка по инструменту-аналогу – игнорируется БРЛ.

8.6 Ограничение на количество транзакций по инструментам

Данная настройка позволяет ограничить количество транзакций на выставление, изменение и снятие заявок в интервал времени в рамках одного пользователя по каждому классу и инструменту. Транзакции по разным классам, инструментам и пользователям не суммируются.

Данная настройка имеет более низкий приоритет относительно аналогичной настройки на вкладке «Пользователи» (см. п. 9).

Изменение данной настройки применяется только после переподключения пользователя.



Параметр	Назначение
Классы	Список классов инструментов, по которым задается ограничение. Новый список классов добавляется нажатием кнопки «Добавить». Для обозначения всех классов укажите <ALL>. Ограничения на пары значений «Класс» + «Инструмент» имеют следующий приоритет (в порядке убывания): _ «Класс» + «Инструмент»; _ <ALL> + «Инструмент»; _ «Класс» + «все инструменты»; _ <ALL> + «все инструменты».
Количество	Максимальное количество транзакций, которое может быть отправлено одним пользователем Сервера QUIK в заданный интервал времени. Поле необязательно для заполнения
Интервал	Время в секундах, в течение которого подсчитываются транзакции. Значение по умолчанию: «1»
Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на количество транзакций действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на количество транзакций. Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»

8.7 Процент изменения цены при замене рыночной заявки лимитированной

Данная настройка позволяет задать параметры преобразования цены последней сделки в цену лимитированной заявки при выставлении рыночных заявок. Если и для покупки, и для продажи указано пустое значение процента изменения цены, то для данного инструмента замена рыночной заявки на лимитированную не используется.

> **Настройка применяется только при поддержке замены рыночной заявки на лимитированную в клиентском терминале.**

Параметр	Назначение
Инструмент	Код инструмента, к которому применяется указанный процент. Для обозначения всех инструментов класса укажите значение <ALL>. Настройка на конкретный инструмент более приоритетна, чем настройка на <ALL>. Параметр обязателен для заполнения
% для покупок	Процент отклонения цены для заявок на покупку
% для продаж	Процент отклонения цены для заявок на продажу

8.8 Параметры учета неторговых поручений

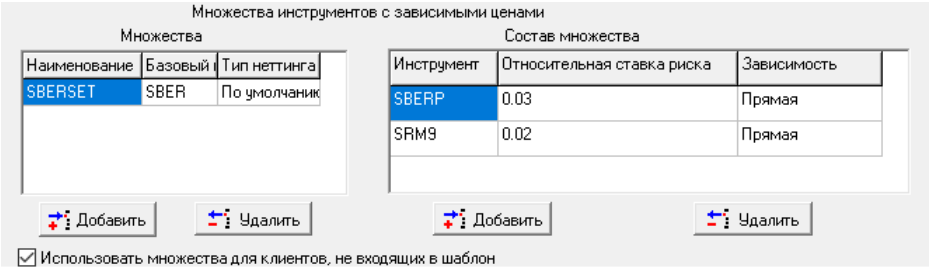
Данная настройка позволяет определить портфель для учета неторговой операции путем привязки инструмента неторговых поручений к тегам и валютам.

Параметр	Назначение
Инструмент	Код инструмента Модуля неторговых поручений. Параметр обязателен для заполнения
Тег расчетов	Тег расчетов для операций по инструменту. Параметр обязателен для заполнения
Валюта	Валюта расчетов для операций по инструменту. Значение по умолчанию: «SUR»

8.9 Множества инструментов с зависимыми ценами

Данная настройка позволяет объединить инструменты с зависимыми ценами, выраженными в одной валюте, во множества с целью снижения размера маржи при работе по схеме кредитования «МД+».

Если включен параметр «Активы в разных валютах в множествах МД+», то во множества могут быть объединены инструменты, цена которых выражена в разных валютах.



Параметр	Назначение
Множества	В настройке определяются множества инструментов с зависимыми ценами
_ Наименование	Наименование множества. Может содержать латинские буквы и цифры без пробелов. Обязательный параметр
_ Базовый индикатор	Код инструмента, относительно которого определяется риск. Базовый индикатор входит во множество по умолчанию, при этом для него зависимость всегда прямая, а относительная ставка риска равна нулю
_ Тип неттинга	Тип неттинга рисков между активами множества в схеме МД+. Возможные значения: _ «По умолчанию» (по умолчанию); _ «Полунеттинг» – требования к обеспечению определяются как максимальная величина риска между суммарными оценками положительных и отрицательных позиций по активам множества; _ «Неттинг» – требования к обеспечению определяются по суммарной оценке всех активов множества. Приоритет выбора типа неттинга см. в Комментарии
Состав множества	
_ Инструмент	Список кодов инструментов, входящих во множество. Один инструмент может входить только в одно множество
_ Относительная ставка риска	Ставка риска относительно базового индикатора. Задается в долях единицы с точностью 8. Возможные значения: от 0 до 1. Значение по умолчанию: «1»
_ Зависимость	Направление зависимости. Возможные значения: _ «Прямая»; _ «Обратная»

Параметр	Назначение
Использовать множества для клиентов, не входящих в шаблон	Признак использования данных множеств при расчете маржи для клиентов, не включенных в какой-либо шаблон «По плечу» (см. п. 15)

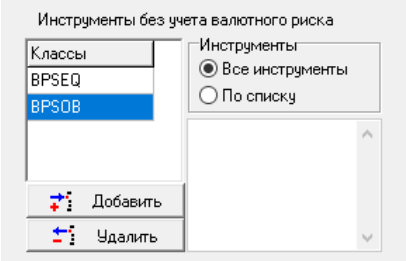
Комментарий

Приоритет выбора типа неттинга (в порядке уменьшения):

1. «Тип неттинга» в используемом множестве;
2. Настройка по шаблону «Тип неттинга по умолчанию в МД+» (см. страницу «Клиенты / Шаблоны / По “плечу”», п. 15);
3. Глобальная настройка «Тип неттинга по умолчанию в МД+» (см. страницу «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования», п. 23).

8.10 Инструменты без учета валютного риска

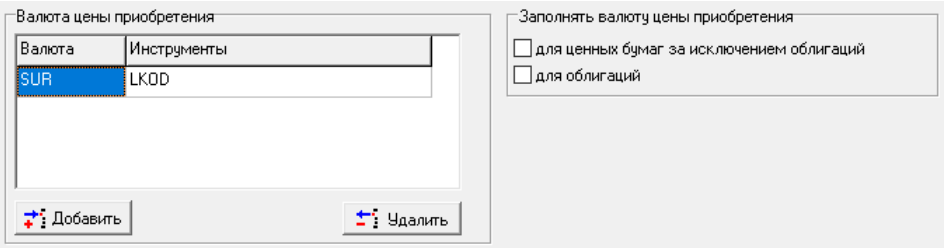
Данная настройка позволяет определить режимы и инструменты, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «МД+».



Параметр	Назначение
Классы	Список классов инструментов, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить». При этом могут быть выбраны все классы (при выборе этого варианта в списке появится значение <ALL>) или наименование из списка. В качестве классов следует указывать только те, в которых может оцениваться портфель (перечисленные в настройке «Список классов для оценки портфеля», см. п. 7)
Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Все инструменты класса

Параметр	Назначение
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми

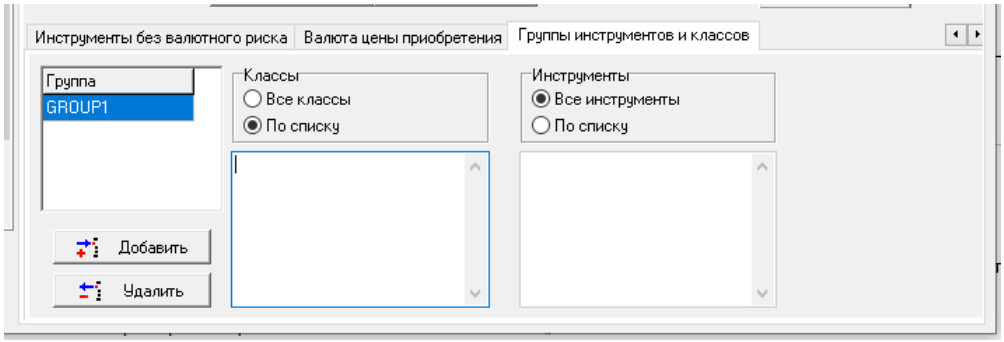
8.11 Валюта цены приобретения



Параметр	Назначение
Валюта цены приобретения	Параметр позволяет определить валюту, в которой выражена цена приобретения инструмента в таблице «Позиции по инструментам» Рабочего места QUIK, в следующих случаях: _ Значение параметра «Валюта цены приобретения» не загружено при установке позиции. В этом случае Сервер QUIK интерпретирует значение цены приобретения в заданной валюте, а Рабочее место QUIK отображает эту валюту в параметре «Валюта цены приобретения». При этом параметр остается незаполненным на сервере QUIK. _ Используется настройка «Заполнять валюту цены приобретения». Настройка не поддерживается для облигаций; если значение параметра «Валюта цены приобретения» не загружено при установке позиции, то цена облигации считается и отображается в процентах от номинала. Чтобы показатели прибыли и убытка в Рабочем месте QUIK рассчитывались корректно, в качестве валюты цены приобретения инструмента необходимо указать валюту, в которой этот инструмент оценивается в портфеле (в соответствии с настройками «Список классов для оценки портфеля» и «Дополнительные классы для оценки портфеля»)
_ Валюта	Валюта расчета цены приобретения инструмента
_ Инструменты	Список инструментов через запятую. Для обозначения всех инструментов укажите <ALL>
Заполнять валюту цены приобретения	Заполнение параметра «Валюта цены приобретения» на сервере QUIK при открытии новой позиции (в том числе в результате переворота), а также при отсутствии значения на существующей позиции на момент совершения операции

Параметр	Назначение
_ для ценных бумаг за исключением облигаций	Признак заполнения параметра для ценных бумаг, за исключением облигаций, валютой, заданной для инструмента в настройке «Валюта цены приобретения», а при ее отсутствии – валютой расчетов по операции. Если флажок выключен, значение параметра не изменяется
_ для облигаций	Признак заполнения параметра для облигаций валютой расчетов по операции. В таком случае будет использоваться чистая цена в валюте расчетов по операции (без НКД). Если флажок выключен, значение параметра не изменяется

8.12 Группы инструментов и классов



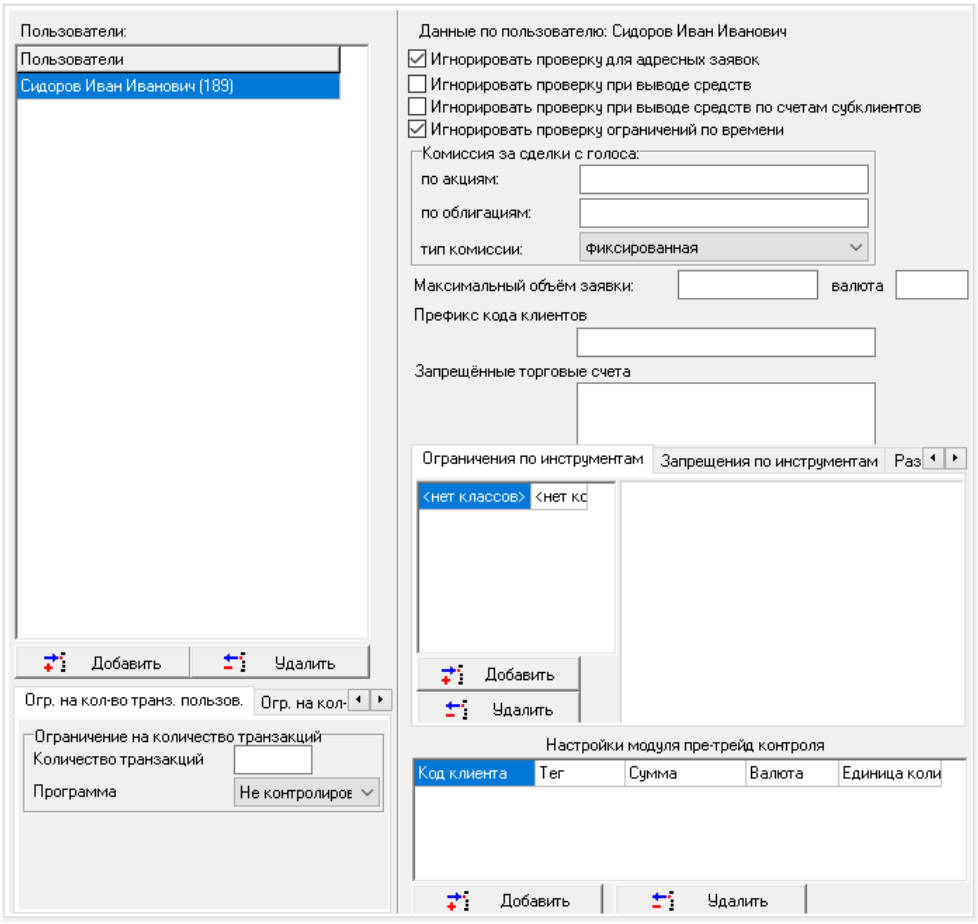
Вкладка «Группы инструментов и классов» используется для создания групп инструментов в привязке к конкретным классам. Группы можно использовать вместо кодов классов в настройках «Комиссия по классам и инструментам» (см. п. 6.3.2) и «Комиссия от объема операции» (см. п. 6.3.1).

На вкладке задаются следующие параметры:

Параметр	Назначение
Группа	Наименование группы. Наименование группы должно состоять из латинских букв и цифр (не более 12 символов) и быть уникальным. Новая группа добавляется нажатием кнопки «Добавить»
Классы	Список классов инструментов
_ Все классы	Включить в группу все классы
_ По списку	Включить в группу список указанных классов. Коды классов указываются через запятую
Инструменты	Список инструментов группы
_ Все инструменты	Включить в группу все инструменты
_ По списку	Список кодов инструментов через запятую

9. Пользователи

Страница «Пользователи» предназначена для настройки ограничений, распространяемых на определенных пользователей клиентских терминалов системы QUIK. Эта страница будет недоступна для редактирования, если на странице «Общие параметры» отключен признак «Проверять ограничения на пользователей».



Параметр	Назначение
Пользователи	Список пользователей, в отношении которых действуют ограничения. Новый пользователь добавляется нажатием кнопки «Добавить». При этом откроется справочник зарегистрированных пользователей, где нужно указать строку и нажать кнопку «Выбрать»
Пользователь не выбран / Данные по пользователю	Заглавие имеет значение «Пользователь не выбран», если в списке «Пользователи» не указан пользователь, для которого задаются ограничения. После выбора пользователя заглавие

Параметр	Назначение
	изменится на «Данные по пользователю:<фамилия и имя пользователя>», а поля станут доступными для редактирования
Игнорировать проверку для адресных заявок	Отключение проверки ограничений для этого пользователя при выставлении адресных заявок. Настройка не распространяет свое действие на классы только с признаком «РЕПО с ЦК» или «РПС с ЦК» и без признаков «РЕПО», «РЕПО-М», «РПС», за исключением классов RPSPBXM и RPSPBBND, на которые данная настройка действует независимо от настроек, заданных непосредственно на класс
Игнорировать проверку при выводе средств	Отключение проверки достаточности средств для поручений на вывод денежных средств
Игнорировать проверку при выводе средств по счетам субклиентов	Отключение проверки достаточности средств на счете пользователя (субклиента) при операции вывода средств, если на счете субброкера верхнего уровня достаточно средств для выполнения операции. Данная настройка предназначена для пользователей с правами менеджера, с целью выполнения необеспеченных операций вывода средств по счетам его субклиентов
Игнорировать проверку ограничений по времени	Отключение проверки ограничений по времени и инструментам (см. п. 25) для любых операций по указанному в настройке UID пользователя
Комиссия за сделки с голоса	Настройка применяется только для представителя брокера. Если заявка выставляется пользователем, для которого указаны значения комиссий в полях «По акциям» и «По облигациям», то все поданные им заявки будут считаться сделками с голоса
_ По акциям	Значение комиссии на сделки с голоса по акциям
_ По облигациям	Значение комиссии на сделки с голоса по облигациям
_ Тип комиссии	Выбор типа комиссии. Возможные значения: _ Фиксированная (в процентах от объема сделки); _ За сделку (в валюте расчетов за сделку, независимо от объема сделки). Значение по умолчанию: фиксированная
Максимальный объем заявки	Максимальный объем одной заявки клиента вне зависимости от класса инструментов. Валюта, в которой задается значение, указывается в поле «Валюта». Настройка имеет более высокий приоритет, чем другие настройки ограничения объёма заявок (см. пп. 10, 14, и 28)
_ Валюта	Валюта максимального объема заявки. Если валюта не указана, значение максимального объема заявки считается заданным в валюте расчетов. Необязательно для заполнения

Параметр	Назначение
* Префикс кода клиентов	Символьный префикс, используемый для установки персонального денежного лимита на данного пользователя, контролируемого в случае отсутствия денежного лимита на код клиента
** Запрещенные торговые счета	Список торговых счетов, по которым данному пользователю запрещены операции
*** Ограничения по инструментам	Настройка ограничений на список инструментов, разрешенных для торговых операций данному пользователю
_ Класс	Список классов, в которых действуют ограничения
_ Список инструментов	Список бумаг в выбранном классе, разрешенных для совершения операций
_ Код расчетов	Код расчетов, используемый при заключении сделки. Если код расчетов задан, то ограничение по инструментам распространяется только на заявки с указанным кодом расчетов. Иначе, ограничение по инструментам распространяется на все допустимые коды расчетов
*** Запрещения по инструментам	Настройка ограничений на список инструментов, запрещенных для торговых операций данному пользователю. Настройка имеет приоритет над настройкой «Ограничения по инструментам»
_ Класс	Список классов, в которых действуют ограничения
_ Список инструментов	Список бумаг в выбранном классе, запрещенных для совершения операций
_ Код расчетов	Код расчетов, используемый при заключении сделки. Если код расчетов задан, то ограничение по инструментам распространяется только на заявки с указанным кодом расчетов. Иначе, ограничение по инструментам распространяется на все допустимые коды расчетов
** Разрешенные торговые счета	Список торговых счетов, по которым данному пользователю разрешены операции
Классы без проверки заявок	Список классов, для заявок по которым для данного пользователя не выполняется проверка достаточности средств. При этом настройка не влияет на блокировку средств
_ Все классы	Отмена проверки достаточности средств действует для всех классов
_ По списку	Список классов, для которых проверка достаточности средств не выполняется
Настройки модуля пре-трейд контроля	Настройки, необходимые для работы Модуля пре-трейд контроля

Параметр	Назначение
_ Код клиента	Полный код клиента (не допускается использование префикса), для которого будет осуществляться проверка и отправка информации в сервер для Модуля пре-трейд контроля
_ Тег	Тег расчетов, для которого осуществляется проверка достаточности средств
_ Сумма	Сумма средств, возможность вывода которой со счёта клиента является сигналом Модулю пре-трейд контроля о разрешении операций по счёту данного клиента. Если сервер QUIK не может позволить вывести со счёта клиента указанную сумму, Модулю пре-трейд контроля будет послан сигнал о запрете дальнейших операций по счёту данного клиента. Значение параметра может быть дополнительно ограничено с помощью настройки «Ограничивать вывод денежных средств для претрейд-контроля» (см. п. 23)
_ Валюта	Валюта исчисления суммы
_ Единица количества	Единица исчисления количества, используемая для вычисления суммы операции клиента. Возможные значения: _ в лотах; _ в штуках
Ограничение на количество транзакций пользователя	Настройка ограничения количества транзакций, отправляемых пользователем в секунду. Изменения данной настройки применяются только после переподключения пользователя. Данная настройка имеет более высокий приоритет относительно аналогичной настройки на вкладке «Общие параметры»
_ Количество транзакций	Максимальное допустимое количество транзакций, отправляемых пользователем в секунду
_ Программа	Включение / отключение контроля количества транзакций для пользователя. Возможные значения: «Контролировать» / «Не контролировать»
Ограничение на количество транзакций пре-трейд контроля	Настройка ограничения количества транзакций, отправляемых пользователем по выбранному коду клиента в указанный промежуток времени. Настройка используется Модулем пре-трейд контроля
_ Код клиента	Код клиента, по которому контролируется ограничение. Значение «*» применяется для обозначения всех клиентов. Настройка, заданная на одного клиента, приоритетнее настройки, заданной на всех клиентов
_ Количество транзакций	Максимальное допустимое количество транзакций, отправляемых пользователем по указанному коду клиента в промежуток

Параметр	Назначение
	времени, заданный в поле «Интервал проверки, мс». Если параметр содержит значение «0», проверка ограничения не выполняется
_ Интервал проверки, мс	Время в миллисекундах, в течение которого подсчитываются транзакции от клиента
_ Интервал блокирования, мс	Время в миллисекундах, на которое блокируется обработка транзакций в случае превышения допустимого количества
_ Программа	Включение / отключение контроля количества транзакций по данному коду клиента для пользователя. Возможные значения: «Контролировать» / «Не контролировать»
Ограничение на количество транзакций по инструментам	Настройка ограничения количества транзакций на выставление, изменение и снятие заявок в интервал времени в рамках одного пользователя по каждому классу и инструменту. Транзакции по разным классам, инструментам и пользователям не суммируются. Данная настройка имеет более высокий приоритет относительно аналогичной настройки на вкладке «Инструменты» (см. п. 8.6). Ограничения на пары значений «Класс» + «Инструмент» имеют следующий приоритет (в порядке убывания): _ «Класс» + «Инструмент»; _ <ALL> + «Инструмент»; _ «Класс» + «все инструменты»; _ <ALL> + «все инструменты». Изменение данной настройки применяется только после переподключения пользователя.
_ Классы	Список классов инструментов, по которым задается ограничение. Новый список классов добавляется нажатием кнопки «Добавить». Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Количество	Максимальное количество транзакций, которое может быть отправлено одним пользователем Сервера QUIK в заданный интервал времени. Поле необязательно для заполнения
_ Интервал	Время в секундах, в течение которого подсчитываются транзакции. Значение по умолчанию: «1»
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на количество транзакций действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на количество транзакций. Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»

(*) Комментарий к префиксу кода клиентов:

Например, если для пользователя «Петров Пётр Петрович» с кодом «100036» задан префикс «PRF», то это означает, что менеджер брокера может поставить денежный лимит на псевдо-клиента «PRF100036». Если в дальнейшем этот пользователь выставляет заявку для клиента, которому не установлен денежный лимит, сделка будет обсчитана на денежном лимите псевдо-клиента «PRF100036».

(**) Комментарии к настройкам «Разрешенные торговые счета» и «Запрещенные торговые счета»:

Для проверки наличия разрешения на совершение операции для определенного торгового счета происходит проверка настроек в следующей последовательности:

1. Если торговый счет есть в списке «Запрещенные торговые счета», то операция запрещена.
2. Если торговый счет есть в списке «Разрешенные торговые счета» и отсутствует в списке «Запрещенные торговые счета», то операция разрешена.
3. Если торговый счет отсутствует в списках «Разрешенные торговые счета» и «Запрещенные торговые счета», но в списке «Разрешенные торговые счета» присутствуют другие торговые счета, то операция запрещена.
4. Если списки «Разрешенные торговые счета» и «Запрещенные торговые счета» пустые, операция разрешена.

(***) Комментарии к настройке «Ограничения по инструментам»:

1. Например, если в списке «Класс» указан класс «TQBR», и для него заданы инструменты с кодами «EESR», «EESRP», то это означает, что данный пользователь сможет по классу «А1-Акции» совершать операции только с бумагами «РАО ЕЭС» и «РАО ЕЭС-п».
2. Если класс не включен в список, пользователю разрешено проводить операции со всеми инструментами этого класса (при наличии прав на работу с этим классом).
3. Для установки ограничений на доступные инструменты всем пользователям используйте страницу «Ограничения на… / Доступные бумаги».
4. Настройки ограничений по инструментам в разрезе кодов расчетов работают независимо от настройки «Игнорировать проверку для адресных заявок».

10.Клиенты / Комиссия брокера

Страница «Клиенты» используется для группировки страниц с настройкой параметров, контролируемых по кодам клиента. Вложенные (подчиненные страницы) разделяются в описании символом «/».

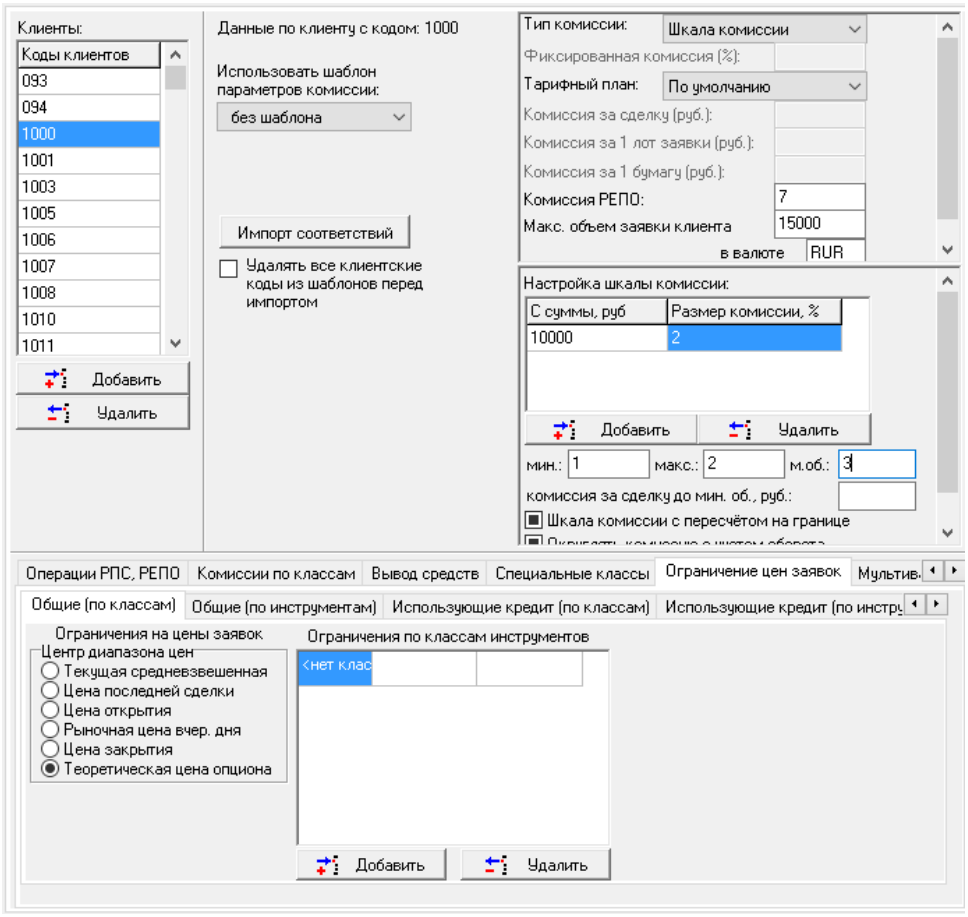
На странице «Комиссия брокера» настраиваются исключения из общих правил расчета комиссионного вознаграждения брокера, заданных «по умолчанию» на странице «Общие параметры».

Настройка осуществляется по следующему принципу:

- В список «Клиенты» добавляются коды клиентов, в отношении которых действуют индивидуальные настройки;
- Для просмотра и настройки ограничений нужно выбрать клиента из списка. На экране отобразится текущее состояние его настроек;
- Ограничения можно задать вручную, или применить шаблон настроек, сформированный на странице «Клиенты/Шаблоны/По комиссии».

Правила расчета комиссии могут быть указаны для группы клиентов по префиксу кода клиента. Если указан код клиента «Е*», то правила расчета распространяются на всех клиентов, код клиента у которых начинается с символа «Е», за исключением тех, которым настроены отдельные правила расчета комиссии или правила расчета комиссии по шаблону (см. п. 14).

> **При настройке расчета комиссии по префиксу кода использование шаблонов не допустимо, т.е. должно быть выбрано значение «без шаблона».**



Параметр	Назначение
Клиенты	Список клиентов, в отношении которых действуют индивидуальные настройки. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1)
Использовать шаблон параметров комиссии	Выбор способа настройки – при помощи шаблона или вручную. Если выбрано значение «Без шаблона», то становятся доступны поля для настроек. Если выбрано название какого-либо шаблона, то принимаются указанные в нем настройки и все остальные поля становятся недоступными (серыми)
Кнопка «Импорт соответствий»	Выбор файла для загрузки соответствий между кодами клиентов и шаблонами тарифных планов. Описание процедуры импорта см. п. 10.1. Формат файла см. п. 10.2
Удалять все клиентские коды из шаблонов перед импортом	Признак очистки текущих настроек соответствий кодов клиентов и шаблонов тарифных планов перед импортом значений из файла. Если признак включен, то перед началом импорта выполняется проверка наличия в импортируемом файле строк с корректным описанием соответствий. Если файл был некорректен либо пуст, то очистка не выполняется

Параметр	Назначение
Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Возможные значения: _ «Фиксированная» – использование одной ставки комиссионного вознаграждения независимо от оборота; _ «Шкала комиссии» – использование шкалы комиссии; _ «За сделку» – использование расчета комиссии в зависимости от количества исполненных поручений, а не от их денежного объема, см. Комментарий 3; _ «Max(сдел., фикс.)» – при расчете выбирается то значение, которое больше. Если процент от заявки меньше фиксированного платежа за совершение операции, то выбирается фиксированный платеж. В противном случае выбирается значение процентов от заявки. Подробнее о расчете комиссии см. Комментарий 4; _ «За лот» – использование расчета комиссии в зависимости от количества лотов в заявке, в штуках (только для спот-рынка); _ «За бумагу» – использование расчета комиссии в зависимости от количества бумаг в сделке, в штуках; _ «Max(сдел., штуку)» – при расчете выбирается то значение комиссии, которое больше. Если комиссия, равная величине комиссии «за штуку», умноженной на количество инструментов в заявке, меньше комиссии, указанной в параметре «за сделку», то выбирается комиссия «за сделку». Иначе выбирается значение комиссии, посчитанной по параметру «за штуку». Под комиссией «за сделку» понимается сумма вознаграждения за поручение (заявку), ее размер не зависит от количества сделок по заявке. Особенности расчёта комиссии в зависимости от типа см. в Комментарии 5
Фиксированная комиссия (%)	Величина фиксированной комиссии, в %. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Фиксированная комиссия» или «Max(сдел., фикс.)»
Тарифный план	Выбор тарифного плана для шкалы комиссии. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». Тарифные планы формируются на странице «Брокерская комиссия». Если другие тарифные планы не заданы, используется тарифный план «По умолчанию»
Комиссия за сделку (руб.)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждое исполненное поручение. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «За сделку», «Max(сдел., фикс.)» или «Max(сдел., штуку)»

Параметр	Назначение
Комиссия за 1 бумагу (руб.)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждую единицу инструмента в заявке. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «За бумагу» или «Max(сдел., штуку)». Для инструментов с дробным количеством комиссия задается из расчета за целую часть значения количества
Комиссия за 1 лот заявки (руб.)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждый лот в заявке. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «За лот»
Комиссия РЕПО	Величина комиссии по сделкам РЕПО, в % за каждый день срока РЕПО. Значение поля не может быть нулевым, нулевое значение будет сброшено при сохранении результатов редактирования. Если значение не указано, то комиссия рассчитывается по глобальным установкам, см. п. 4.6. Параметр имеет меньший приоритет по отношению к настройке комиссии по классам, задаваемой на вкладке «Комиссии по классам». Для классов РЕПО настройка имеет более высокий приоритет, чем другие настройки комиссии, заданные на код клиента. Если флажок «Приоритет комиссии в шаблоне для операций РЕПО» (см. п. 4.8) включен, то в рамках настроек комиссии, заданных на код клиента, комиссия РЕПО менее приоритетна, чем настройки комиссии, заданные на конкретный класс. При этом следует учитывать, что: _ комиссия может быть задана на класс через выбранный тарифный план; _ «нулевая комиссия» в тарифном плане (см. п. 6.1.1) не считается настройкой, заданной на класс, и имеет меньший приоритет, чем комиссия РЕПО
Макс. объем заявки клиента	Максимальный размер одной заявки клиента вне зависимости от класса инструментов, выраженный в валюте, указанной в поле «в валюте»
_ в валюте	Валюта, в которой указывается максимальный размер заявки клиента
Игнорировать комиссии за сделки с голоса	Отключает снятие комиссии за сделки с голоса по данному клиенту
Настройка шкалы комиссии	Настройка шкалы комиссии. Параметр «Типа комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». О правилах настройки шкалы комиссии см. п. 4.7. Валюта, в которой интерпретируются значения суммы, комиссии и оборота в данной настройке, может быть изменена для заданного списка классов (подробнее см. п. 6.2.1)
_ С суммы, руб.	Нижняя граница дневного оборота клиента, с которой начинается применение данной ставки комиссии

Параметр	Назначение
_ Размер комиссии, %	Величина комиссионного вознаграждения в процентах
Мин.	Минимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
Макс.	Максимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
М. об.	Минимальный дневной оборот, с которого начисляется комиссия, в валюте расчетов
Комиссия за сделку до мин. Об.	Фиксированная комиссия за каждую сделку, в валюте расчетов. Комиссия взимается до тех пор, пока дневной оборот не превысит значения «М. об.». По умолчанию поле пустое
Шкала комиссии с пересчетом на границе	Включает перерасчет значения комиссии при переходе границы между различными процентными ставками. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». Флажок имеет три состояния: «включен» – значения комиссии определяется, исходя из дневного оборота клиента и шкалы комиссии, «выключен» – перерасчет не применяется, закрашенный квадрат – используется глобальная настройка. Подробнее о пересчете см. п. 4.1
Округлять комиссию с учетом оборота	Включает корректный расчет комиссии в случаях сделок малого объема и при частичном исполнении заявки несколькими сделками меньшего объема. Флажок имеет три состояния: «включен» – комиссия брокера по шкале округляется на суммарный торговый объем клиентских операций за день, «выключен» – не применяется, закрашенный квадрат – используется глобальная настройка. Подробнее см. п. 4.1
Вкладка «Разрешения по классам», см. Комментарий 1	
Разрешенные для торговли бумаги	Настройка списка бумаг, разрешенных клиенту для совершения торговых операций. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, разрешенных для торговли
_ Класс	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка
_ Список инструментов	Список идентификаторов разрешенных бумаг, через запятую. Для обозначения всех бумаг класса укажите <All>. Так же возможно использовать префикс для инструментов, например, можно разрешить все бумаги, начинающиеся на A*

Параметр	Назначение
Вкладка «Запрещения по классам», см. Комментарий 1	
Запрещенные для торговли бумаги	Настройка списка бумаг, запрещенных клиенту для совершения торговых операций. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, запрещенных для торговли. Правила настройки те же, что и для вкладки «Разрешения по классам»
Запрещения на открытие позиций	Настройка списка инструментов, запрещенных клиенту для открытия новых позиций, а также для наращивания (по модулю) ранее открытых позиций. Для пользователей с включенной настройкой «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу настройка игнорируется. Для обозначения всех инструментов класса укажите в качестве кода инструмента <All>. Также возможно использовать префикс кода инструмента. Например, можно запретить все инструменты, начинающиеся на RI*. Действие настройки «Запрещения на открытие позиций» распространяется только на инструменты, торговля которыми не запрещена другими настройками. См. Комментарий 2
Вкладка «Разрешения по счетам»	
Разрешенные для торговли бумаги (по счетам)	Настройка списка бумаг, разрешенных клиенту для совершения торговых операций по указанному счету. Если какой-либо счет включен в список «Счет», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, разрешенных для торговли
_ Торговый счет	Код торгового счета, в отношении которого действует ограничение. Новый счет добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом обозначения счета в открывшемся окне
_ Список инструментов	Список идентификаторов разрешенных бумаг, через запятую
Вкладка «Операции РПС, РЕПО», приоритет использования настроек см. в Комментарии 7	
Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета	
Разрешённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, разрешенных для операций РПС, РЕПО
_ Все коды расчётов	Разрешены все коды расчетов
_ По списку	Разрешены коды расчетов, перечисленные в списке через запятую. Использование префикса кода расчетов не допускается
Запрещённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, запрещенных для операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных кодов
Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента	

Параметр	Назначение
Разрешённые контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую. Указание префикса контрагента не допускается
Запрещённые контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных контрагентов
Вкладка «Комиссии по классам»	
Комиссия по классам и инструментам	Настройка типов комиссии для отдельных классов и групп инструментов. Приоритет выбора ставки комиссии см. в п. 6.3.2
_ Класс/Группа	Код класса или группы, для инструментов которых назначена комиссия. Чтобы добавить класс / группу, нажмите на кнопку «Добавить», в открывшемся окне выберите тип создаваемого элемента (класс / группа), выберите код класса / группы и нажмите кнопку «OK»
_ Тип комиссии	Способ указания комиссии. Описание типов комиссии приведено выше в данной таблице
_ Величина	Величина брокерской комиссии. Для комиссий типа «Max» – величина брокерской комиссии за сделку. Единицы измерения зависят от выбранного типа комиссии
_ Величина 2	Для типа комиссии «Max(сдел., фикс.)» – фиксированная величина брокерской комиссии в процентах. Для типа комиссии «Max(сдел., штуку)» – величина брокерской комиссии за единицу инструмента в валюте расчетов
Валюта списания комиссии	Настройка списка кодов валют, в которых производятся проверка и блокировка по заявке, а также разблокировка и списание по сделке. Используется для схем кредитования клиентов «по дисконтам», «МД+» и «по плечу». Если при использовании настройки «Вести денежные позиции в разрезе валют» настройка «Валюта списания комиссии» включена, то настройка «Валюта расчета комиссии» (см. п. 6.1.4) также должна быть включена. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройки «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции (при отсутствии лимитов) и «Игнорировать проверку для адресных заявок»
Не пров. при отл. вал. расчетов	Не проверять достаточность средств под комиссию, если валюта списания комиссии отличается от валюты расчетов

Параметр	Назначение
Запр. опер. при нехв. сред. под ком.	Запрет операций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке запрещены все операции (в том числе закрытие позиций) по классам, перечисленным в списке, если объём комиссии превышает доступный остаток в указанной валюте списания комиссии. При закрытии позиций достаточность объёма под комиссию проверяется только на плановом виде лимита по указанной валюте. По умолчанию настройка выключена
Разр. зак. поз. при нехв. ср. под ком.	Разрешить закрытие позиций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке разрешены операции закрытия позиций при нехватке средств под комиссию. Настройка имеет смысл при включенной настройке «Запр. опер. при нехв. сред. под ком.». По умолчанию настройка выключена
_ Валюта	Код валюты, в которой сервер QUIK списывает комиссию. О недопустимых значениях см. в Комментарии 9
_ Тип комиссии	Тип комиссии. Возможные значения: _ «Суммарная» – комиссия брокера и торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового (акции, облигации) и валютного рынков; _ «ТС» – комиссия торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового рынка (акции, облигации). О недопустимых значениях см. в Комментарии 9
_ Список классов	Список классов через запятую, для которых указан код валюты комиссии. О недопустимых значениях см. в Комментарии 9
Классы без учета комиссии ТС	
_ Классы	Наименование класса, в котором действует ограничение. Настройка позволяет определить классы, для которых не будет применяться комиссия торговой системы. В качестве значения настройки указывается список классов через запятую. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка. Класс удаляется нажатием кнопки «Удалить» и выбором наименования из списка. Настройка имеет более высокий приоритет, чем настройка «Использовать комиссию ТС». По умолчанию настройка не задана
Вкладка «Комиссия от объема операции». Об особенностях задания настроек см. в Комментарии 8	
Классы/Группы	Список классов /групп через запятую, для которых действуют ставки комиссии.

Параметр	Назначение
	Настройка применяется для операций на фондовом рынке (акции, облигации), в том числе для операций РЕПО (денежный рынок). Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с глобальной настройкой «Комиссия от объема операции» на странице «Брокерская комиссия», вкладка «Ставки» (см. п. 6.3.1). Настройка имеет самый высокий приоритет среди всех настроек комиссии брокера, заданных на код клиента. Если настройка задана на префикс кода клиента, то она имеет самый высокий приоритет среди всех настроек комиссии брокера, заданных на тот же префикс кода клиента
Объем	Нижняя граница объема поручения, к которой применяется данная ставка комиссии, в валюте параметров комиссии (см. п. 6.2.1). Если настройка «Валюта параметров комиссии» для класса не задана, то значение объема интерпретируется в рублях. Для операций РЕПО комиссия рассчитывается исходя из объема первой части операции
Направление	Направление операции. Для операций РЕПО – направление первой части. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа»; _ «Не задано» – комиссия применяется к операциям любого направления
Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Возможные значения: _ «% от объема» – процент от объема поручения; _ «Max (%; за поручение)» – используется большее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение; _ «Min (%; за поручение)» – используется меньшее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение
% от объема	Сумма комиссии вычисляется как процент от объема поручения
За поручение	Максимальная или минимальная (в зависимости от типа комиссии) сумма комиссии брокера по всем сделкам в рамках одного поручения
Вкладка «Вывод средств»	
Классы вывода средств	Список классов, операции по которым не приводят к увеличению текущих остатков средств клиента по деньгам (при продаже) и по инструментам (при покупке)

Параметр	Назначение
Режимы вывода денежных средств	Список классов, операции по которым не приводят к увеличению текущих остатков средств клиента по деньгам (при продаже), но при покупке зачисление инструментов на счет производится
Вкладка «Специальные классы»	
Классы без расчёта и контроля лимитов	Список классов инструментов, по которым не выполняются проверки достаточности средств для исполнения заявок клиента. Для указанных классов настройки «Ограничения по классам инструментов» и «Ограничения по инструментам», заданные на странице «Ограничения на … / Цены заявок» (см. п. 20), игнорируются. Список, указанный в данной настройке, дополняет глобальный список на странице «Классы»
Классы с проверкой регистрационного номера бумаги (CFI кода)	Список классов бумаг, по которым осуществляется проверка допустимости CFI кода. Настройка не учитывается для операций закрытия позиций
Классы без блокировки средств под заявки	Список классов бумаг, при торговле которыми будут применены особые правила: _ при подаче заявки осуществляется только проверка соответствия параметров заявки ограничениям (на цену, объем и т.д.), проверка покупательной способности клиента не производится; _ не блокируются средства под заявку; _ при регистрации сделки производится безусловное начисление/списание средств. Список, указанный в данной настройке, дополняет глобальный список на странице «Классы»
Классы с контролем минимального количества в заявках	Контроль минимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. При проверке игнорируется опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3)
_ Список классов	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиента
_ Количество	Минимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, меньше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то используется значение параметра «Минимальное кол-во» из Таблицы текущих торгов инструмента заявки. Если значение в Таблице текущих торгов не удалось найти, заявка отвергается с диагностикой «Неверно указано количество»

Параметр	Назначение
Классы с контролем минимального объема в заявках	Контроль минимально допустимого объема заявки по заданному классу инструментов
_ Список классов	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимый объем заявки
_ Объем	Минимальный объем одной заявки клиента, выраженный в валюте расчетов. Заявки с объемом, меньше заданного, отвергаются при проверке покупательной способности
_ Валюта	Валюта, в которой задается ограничение минимального объема в заявках. Значение допустимого объема заявки рассчитывается в заданной валюте, и, если валюта расчетов отличается от заданной, ограничение пересчитывается согласно кросс-курсу. Если валюта не задана, то значение ограничения рассчитывается в валюте расчетов без конвертации
Позиции в разрезе валют	Список классов, в которых торгуются валютные пары. По инструментам из этих классов не устанавливаются и не ведутся лимиты по бумагам. При регистрации сделок с валютными парами в QUIK меняются только денежные позиции по соответствующим валютам. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с глобальной настройкой «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы». При использовании схемы кредитования клиентов «по дисконтам» или «МД+» для корректной работы функционала ведения денежных позиций в разрезе валют также необходимо указать значения дисконтов на используемые валюты в настройках вида «Список дисконтов по бумагам». Используемые валюты должны быть объединены в рамках настройки «Доп. теги расчетов» / «Дополнительные валюты»
Классы, в которых запрещено выставление стоп-заявок	Список классов инструментов, по которым запрещено выставление стоп-заявок. Настройка проверяется также для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции
Вкладка «Ограничение цен заявок» Индивидуальные настройки ограничений цен заявок, использующих либо не использующих кредитные ресурсы. Настройки могут быть заданы на код клиента, по префиксу клиентского кода либо в виде шаблона (см. п. 14). Набор параметров и их назначение аналогичны глобальным настройкам, описанным в п. 20	
Вкладка «Мультивал. ден. позиция»	

Параметр	Назначение
Индивидуальные настройки мультивалютной денежной позиции. Индивидуальные настройки имеют более высокий приоритет относительно глобальных настроек. Набор параметров и их назначение аналогичны глобальным настройкам, описанным в п. 19. Описание таблицы «Дополнительные валюты» приведено в п. 17	
Вкладка «Комиссия по баз. активу»	
Индивидуальная настройка величины комиссии, по сделкам с фьючерсами на ФОРТС. Задается отдельно для каждого базового актива, в валюте расчетов за лот. Назначение настройки аналогично глобальной настройке, описанной в п. 4.8 (раздел «Общие параметры» / «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» / «По базовому активу»)	
Вкладка «Запр. РПС, РЕПО по классам», приоритет, особенности и примеры использования настроек см. в Комментарии 6	
Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Запрещены все контрагенты
_ По списку	Запрещены контрагенты, перечисленные в списке через запятую
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»

Параметр	Назначение
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки больше указанного, операция запрещена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»
Вкладка «Разр. РПС, РЕПО по классам», приоритет, особенности и примеры использования настроек см. в Комментарии 6	
Разрешенные контрагенты и коды расчётов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки меньше или равен указанному, операция разрешена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»
Вкладка «Комиссия РЕПО» — задание ставок для разных классов	

Параметр	Назначение
Комиссия РЕПО по классам за день срока	Ставки комиссии РЕПО за день срока в разрезе классов
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Настройка на конкретный класс приоритетнее, чем настройка на <ALL>
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения: _ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в процентах от суммы РЕПО за каждый день срока; _ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Обязательно для заполнения для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно. Значение по умолчанию «0» – не задано
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
Вкладка «Шкала комиссии РЕПО» – настройка ставки комиссии РЕПО	
Шкала комиссии РЕПО по классам	Шкала ставок комиссии РЕПО в разрезе классов. Настройка имеет более высокий приоритет, чем настройка «Комиссия РЕПО по классам за день срока»
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Обязательно для заполнения при добавлении строки. Дублирование кода класса не допускается
_ Срок РЕПО	Срок сделки РЕПО. Ставка применяется к сделкам, срок РЕПО которых больше или равен заданному количеству дней при отсутствии подходящей ставки с большим количеством дней. Срок РЕПО задается обязательно начиная с 0
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения: _ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в % от суммы РЕПО за каждый день срока;

Параметр	Назначение
	_ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Доступно для редактирования для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно

Комментарии к таблице:

Комментарий 1

При проверке доступности бумаги для торговых операций клиента, настройки проверки разрешений и запрещений для указанных в заявке кода класса и кода инструмента имеют следующий приоритет, от более высокого к более низкому:

1. Глобальная запрещающая настройка (страница «Ограничения на … / Доступные бумаги», см. п. 25). Запрещающее действие этой настройки перекрывает любые разрешения, полученные от описанных ниже настроек.
2. Индивидуальная разрешающая настройка (страница «Клиенты / Комиссия брокера», вкладка «Разрешения по классам», см. п. 10 или страница «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», вкладка «Разрешения по классам», см. п. 14). Порядок включения клиента в шаблон «По комиссии» описан в п. 14.
   - указаны класс и бумага – торговля по данной бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается;
   - указан класс, но не указана бумага – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается;
   - не указан нужный класс, но указаны другие классы – проверяется наличие индивидуального запрета на торговлю по данной бумаге данного класса (см. п. 1 шага 4);
   - настройка не заполнена – проверяется глобальная разрешающая настройка (см. шаг 3).
3. Глобальная разрешающая настройка (страница «Ограничения на … / Доступные бумаги», см. п. 25):

- указаны класс и бумага – торговля по данной бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается;
- указан класс, но не указана бумага – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается;
- не указан нужный класс, но указаны другие классы – проверяется наличие индивидуального запрета на торговлю по данной бумаге данного класса (см. п. 2 шага 4);
- настройка не заполнена – проверяется наличие индивидуального запрета на торговлю по данной бумаге данного класса (см. п. 2 шага 4).

4. Индивидуальная запрещающая настройка (страница «Клиенты / Комиссия брокера», вкладка «Запрещения по классам», см. п. 10 или страница «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», вкладка «Запрещения по классам», см. п. 14). Порядок включения клиента в шаблон «По комиссии» описан в п. 14.

- Если индивидуальная разрешающая настройка заполнена, но в ней отсутствует нужный класс:
  - указаны класс и бумага – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается;
  - не указан класс – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается;
  - указан нужный класс, но другая бумага – торговля по указанной в заявке бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается;
  - настройка не заполнена – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается.
- Если индивидуальная разрешающая настройка не заполнена, и нужный класс отсутствует в глобальной разрешающей настройке:
  - указаны класс и бумага – торговля по данной бумаге данного класса запрещена, проверка прекращается;
  - не указан класс – торговля по указанной в заявке бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается;
  - указан нужный класс, но другая бумага – торговля по указанной в заявке бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается;
  - настройка не заполнена – торговля по указанной в заявке бумаге данного класса разрешена, проверка прекращается.

> **Бумага может быть указана с помощью значения <All> либо с использованием префикса.**

Операции РЕПО и РПС с кодами расчетов, начинающимися на «B», «S» или «Y», запрещаются данной настройкой только в том случае, если по ним производится проверка покупательной способности хотя бы на одном сроке расчетов (хотя бы на одном виде лимитов). Если же Библиотека расчета лимитов по таким заявкам проверку покупательной способности не выполняет, то такие операции считаются разрешенными и не проверяются сервером, независимо от того, включены ли они в списки разрешенных / запрещенных кодов расчетов.

Комментарий 2: настройка «Запрещения на открытие позиций»

Одним из типовых сценариев использования настройки «Запрещения на открытие позиций» является глобальный запрет на открытие позиций по бумаге и одновременное индивидуальное разрешение на уровне клиентских настроек (по коду клиента, шаблону или префиксу). Чтобы разрешить на уровне клиентских настроек открытие позиций по глобально запрещенной бумаге, в индивидуальной секции настроек нужно указать фиктивный список бумаг в качестве, запрещенных по данному классу. Например, бумагу X для класса TQBR. В этом случае открытие позиций будет возможно по всем бумагам указанного класса, кроме X, несмотря на действующие глобальные запреты. Также на уровне клиентских настроек возможно указание запрета по фиктивному классу, например, бумага <ALL> для класса Y. В этом случае открытие позиций для соответствующих клиентов будет доступно по любому классу, кроме Y, несмотря на действующие глобальные запреты.

Комментарий 3: тип комиссии «За сделку»

Данный тип комиссионного вознаграждения рассчитывается системой QUIK по количеству исполненных поручений клиента, а не по количеству совершенных сделок в торговой системе. Например, если от клиента поступила одна заявка, которая исполнилась в торговой системе биржи пятью частями, т.е. пятью сделками, то комиссия будет взята один раз.

Комментарий 4: тип комиссии «Max(сдел., фикс.)»

Для типа комиссии «Max(сдел., фикс.)» сумма комиссии определяется следующим образом:

TradeChargeCommission=RoundUp(Comm(ExecVol))-RoundUp(Comm(PrevExecVol))

Где:

- TradeChargeCommission – сумма комиссии за сделку, подлежащая списанию.
- ExecVol – исполненный объем заявки с учетом текущей сделки, для которой определяется сумма комиссии к списанию.
- PrevExecVol – объем заявки, исполненный ранее (без учета текущей сделки).
- Comm(X) – функция вычисления суммы комиссии брокера для объема X.
- RoundUp(X) – функция округления значения X вверх до целых копеек/центов и т.п.

Пример:

Исполнены две сделки на один и тот же объем X. Комиссия за сделку объемом X равна 0.003 копейки. Тогда по первой сделке комиссия 0.003 округляется вверх до 1 копейки, а по второй сделке комиссия равна 0:

TradeChargeCommission=1 коп - 1 коп = 0 коп.

Итого суммарная комиссия по двум сделкам равна 1 копейке.

Комментарий 5: Расчёт комиссии

При подаче транзакции на выставление заявки на покупку или продажу в денежной схеме для клиентов «МД» или «МП» комиссия брокера и комиссия ТС (в случае её расчёта сервером QUIK) рассчитываются следующим образом:

- Для типа комиссии «Шкала комиссии» – с использованием кросс-курса сервера QUIK;
- Для остальных типов комиссии – исходя из цены заявки.

На валютном рынке по сделке на продажу в денежной схеме для клиентов «МД» или «МП» комиссия брокера и комиссия ТС (в случае её расчёта Сервером QUIK) рассчитываются исходя из цены сделки для всех типов комиссии (в том числе и для типа комиссии «Шкала комиссии»).

Комментарий 6: Вкладки «Запр. РПС, РЕПО по классам» и «Разр. РПС, РЕПО по классам»

ВАЖНО!

- Настройки используются только с адресными режимами торгов и не оказывают влияния на безадресные режимы. Настройки игнорируются для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу или выбранной настройкой «Игнорировать проверку для адресных заявок»
- Для корректной работы настройки «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» необходимо использовать настройку «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов», установив переключатель «все контрагенты» в рамке «Контрагенты» для тех же классов, которые указаны в разрешающей настройке, без указания направления, кодов расчетов и срока РЕПО.

Для проверки наличия разрешения на совершение операции РЕПО или РПС происходит проверка настроек в следующей последовательности:

1. Индивидуальная разрешающая настройка (страница «Клиенты / Комиссия брокера», настройка «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Разр. РПС, РЕПО по классам», см. п. 10 или страница «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», настройка «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Разр. РПС, РЕПО по классам», см. п. 14). Порядок включения клиента в шаблон «По комиссии» описан в п. 14.
   - найдена настройка с нужным сочетанием параметров – операция разрешена, проверка успешно пройдена;
   - иначе – см. шаг 2.
2. Индивидуальная запрещающая настройка (страница «Клиенты / Комиссия брокера», настройка «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Запр. РПС, РЕПО по классам», см. п. 10 или страница «Клиенты / Шаблоны /

По комиссии», настройка «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Запр. РПС, РЕПО по классам», см. п. 14). Порядок включения клиента в шаблон «По комиссии» описан в п. 14.

- найдена настройка с нужным сочетанием параметров – операция запрещена, проверка прекращается;
- иначе – см. шаг 3.

3. Глобальная разрешающая настройка (страница «Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО», настройка «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Настройки РПС, РЕПО по классам», см. п. 30):
   - найдена настройка с нужным сочетанием параметров – операция разрешена, проверка успешно пройдена;
   - иначе – см. шаг 4.
4. Глобальная запрещающая настройка (страница «Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО», настройка «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» на вкладке «Настройки РПС, РЕПО по классам», см. п. 30):
   - найдена настройка с нужным сочетанием параметров – операция запрещена, проверка прекращается;
   - иначе – проверка успешно пройдена.

Пример 1: Требуется для некоторых клиентов разрешить РПС операции только с кодами расчётов B0, B01 и B02 и только с контрагентами PARTNER01 и PARTNER02; всем остальным клиентам запретить любые операции РПС.

Настройки Библиотеки расчёта лимитов:

1. Глобальной настройкой запрещаются операции РПС:
   На странице «Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО» откройте вкладку «Настройки РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РПС».
2. Клиенты, для которых необходимо разрешить операции РПС, помещаются в шаблон настроек по комиссии:
   На странице «Клиенты / Шаблоны / По комиссии» откройте вкладку «Разр. РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РПС». В столбце «Коды расчётов» напротив добавленного правила впишите через запятую коды расчётов B0,B01,B02. Установите переключатель «Контрагенты» в положение «по списку» и в поле справа впишите через запятую разрешённые коды контрагентов: PARTNER01,PARTNER02. В списке «Направление» выберите «Не задано», поле «Макс. срок РЕПО» оставьте пустым.

Пояснения к примеру:

- **ВАЖНО!** Для решения приведённой задачи необходимо явно добавить глобальную запрещающую настройку на все режимы РПС, т.к. наличие только

разрешающей настройки не запрещает операции, не указанные в разрешающей настройке.

- Так как приоритет разрешающей настройки выше приоритета запрещающей, то для клиентов, входящих в добавленный шаблон по комиссии, операции РПС с указанными в настройке параметрами разрешены. При этом прочие операции РПС для данных клиентов запрещены (например, с кодами расчётов B03, B04, B05 и т.д., независимо от кода контрагента, или с контрагентами, код которых отличается от PARTNER01 и PARTNER02, независимо от кода расчётов), так как подходящей разрешающей настройки нет, но есть менее приоритетная запрещающая на все операции РПС.

Пример 2: Требуется для некоторых клиентов разрешить операции РЕПО с контрагентом PARTNER01 и для этих же клиентов запретить любые операции РЕПО с контрагентом PARTNER02. Для остальных клиентов необходимо запретить операции РЕПО с контрагентами PARTNER01 и PARTNER02.

РЕПО операции для всех клиентов с кодами партнёров, отличными от PARTNER01 и PARTNER02, должны быть разрешены.

Настройки Библиотеки расчёта лимитов:

1. Глобальной настройкой запрещаются операции РЕПО с контрагентами PARTNER01 и PARTNER02:
   На странице «Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО» откройте вкладку «Настройки РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РЕПО». Далее установите переключатель «Контрагенты» в положение «по списку» и в поле ниже впишите через запятую коды PARTNER01 и PARTNER02.
2. Клиенты, для которых необходимо разрешить операции РЕПО с контрагентом PARTNER01, помещаются в шаблоны настроек по комиссии:
   На странице «Клиенты / Шаблоны / По комиссии» откройте вкладку «Разр. РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РЕПО». Установите переключатель «Контрагенты» в положение «по списку» и в поле справа впишите код PARTNER01. В списке «Направление» выберите «Не задано», поле «Макс. срок РЕПО» оставьте пустым.

Пояснения к примеру:

- Так как приоритет разрешающей настройки выше запрещающей, то для клиентов, входящих в добавленный шаблон по комиссии, операции РЕПО с указанными в разрешающей настройке параметрами разрешены (РЕПО с PARTNER01). При этом для клиентов из шаблона запрещены те операции РЕПО, которые запрещены глобально (РЕПО с PARTNER02).
- Для клиентов, не входящих в шаблон, действует глобальная запрещающая настройка на операции РЕПО с PARTNER01 и PARTNER02.

- Для операций РЕПО с другими кодами партнёров нет запрещающих настроек, поэтому по умолчанию РЕПО операции с другими кодами партнёров считаются разрешёнными.

Пример 3: Требуется для некоторых клиентов разрешить операции обратного РЕПО (направление первой части – покупка) с контрагентом PARTNER01, если срок РЕПО не превышает 5 дней.

В настройках Библиотеки расчёта лимитов клиенты, для которых необходимо разрешить операции, помещаются в шаблоны настроек по комиссии:

1. На странице «Клиенты / Шаблоны / По комиссии» откройте вкладку «Разр. РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РЕПО». Установите переключатель «Контрагенты» в положение «по списку» и в поле справа впишите код PARTNER01. В списке «Направление» выберите «Покупка», в поле «Макс. срок РЕПО» укажите значение «5».
2. На странице «Клиенты / Шаблоны / По комиссии» откройте вкладку «Запр. РПС, РЕПО по классам» и добавьте в список «Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов» элемент с типом «Все классы РЕПО». Установите переключатель «Контрагенты» в положение «все контрагенты», в списке «Направление» выберите «Покупка».

Пояснения к примеру:

- Так как приоритет разрешающей настройки выше запрещающей, то для клиентов, входящих в добавленный шаблон по комиссии, операции РЕПО с указанными в разрешающей настройке параметрами разрешены (РЕПО с PARTNER01, с направлением первой части сделки «покупка» и сроком не более 5 дней). Операции с этими же параметрами, но со сроком РЕПО более 5 дней запрещены запрещающей настройкой.
- Для клиентов, входящих в шаблон, операции с любым другим сочетанием настроек разрешены.

Комментарий 7: Вкладка «Операции РПС, РЕПО»

Для проверки наличия разрешения на совершение операции РЕПО или РПС с использованием определенного **кода расчётов** происходит проверка настроек в следующей последовательности:

1. Если код расчета есть в списке разрешенных в шаблонной (страница «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 14) или индивидуальной (страница «Клиенты / Комиссия брокера», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 10) настройках, то он разрешен.
2. Если индивидуальная и шаблонная настройка разрешенных кодов расчетов отсутствуют, но код расчета есть в списке глобальной настройки разрешенных кодов расчетов (страница

«Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 30), то он разрешен.

3. Если код расчета есть в списке запрещенных в шаблонной (см. п. 14) или индивидуальной (см. п. 10) настройках, то он запрещен.
4. Если индивидуальная и шаблонная настройка запрещенных кодов расчетов отсутствуют, но код расчета есть в списке глобальной настройки запрещенных кодов расчетов (см. п. 30), то он запрещен.
5. Если код расчетов не указан в шаблонной (см. п. 14), индивидуальной (см. п. 10) и глобальной (см. п. 30) настройках запрещенных кодов расчетов, то он разрешен.

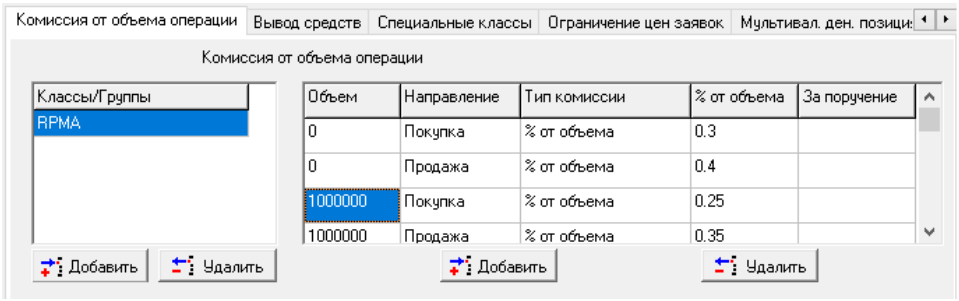
Для проверки наличия разрешения на совершение операции РЕПО или РПС с определенным **контрагентом** происходит проверка настроек в следующей последовательности:

1. Если код контрагента есть в списке разрешенных в шаблонной (страница «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 14) или индивидуальной (страница «Клиенты / Комиссия брокера», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 10) настройках, то он разрешен.
2. Если индивидуальная и шаблонная настройка разрешенных кодов контрагентов отсутствуют, но код контрагента есть в списке глобальной настройки разрешенных кодов контрагентов (страница «Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО», настройка «Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента» на вкладке «Операции РПС, РЕПО», см. п. 30), то он разрешен.
3. Если код контрагента есть в списке запрещенных в шаблонной (см. п. 14) или индивидуальной (см. п. 10) настройках, то он запрещен.
4. Если индивидуальная и шаблонная настройка запрещенных кодов контрагентов отсутствуют, но код контрагента есть в списке глобальной настройки запрещенных кодов контрагентов (см. п. 30), то он запрещен.
5. Если код контрагента не указан в шаблонной (см. п. 14), индивидуальной (см. п. 10) и глобальной (см. п. 30) настройках запрещенных кодов контрагентов, то он разрешен.

Комментарий 8: вкладка «Комиссия от объема операции»

Обязательно задание значения комиссии для нулевого объема (значение «0» в колонке «Объем») для обоих направлений операции сразу (значение «Не задано» в колонке «Направление») или для каждого направления отдельно (значения «Покупка» и «Продажа»).

Например:



В примере, представленном на скриншоте, комиссия задается начиная с нулевого объема:

- для поручений с объемом от 0 до 999999,99 применяется комиссия по ставке 0,3% от объема поручения на покупку и 0,4% от объема поручения на продажу;
- для поручений с объемом от 1000000 применяется комиссия по ставке 0,25% от объема поручения на покупку и 0,35% от объема поручения на продажу.

Комментарий 9: настройка «Валюта списания комиссии»

Не допускается указание одного класса для разных валют и одного типа комиссии, а также дублирование сочетания кода валюты и типа комиссии в разных строках таблицы. Если класс указан одновременно для типов комиссии «ТС» и «Суммарная», то для комиссии брокера используется код валюты, указанный для типа комиссии «Суммарная».

10.1 Импорт соответствий кодов клиентов и шаблонов комиссии

Импорт соответствий кодов клиентов предназначен для изменения или присвоения существующему коду клиента какого-либо шаблона комиссии. Данный функционал позволяет добавлять в шаблон новые коды клиентов. Под новым кодом клиента понимается такой код, который не состоит в перечне кодов клиента какого-либо существующего шаблона и для которого не настроена индивидуальная комиссия.

Процедура импорта выглядит следующим образом:

1. ПО сохраняет информацию о соответствии кодов клиентов шаблонам тарифных планов в текстовый файл, формат которого описан в п. 10.2.
2. В настройках Библиотеки расчета лимитов необходимо выбрать страницу **Клиенты / Комиссия брокера** и нажать на кнопку «Импорт соответствий». В открывшемся окне необходимо указать файл для загрузки и нажать кнопку «ОК» для начала процедуры импорта данных.
3. Если при этом установлен признак «Удалять все клиентские коды из шаблонов перед импортом», то перед импортом будет произведена очистка старых настроек соответствий.

При обработке файла будут выполнены следующие проверки:

- Файл содержит хотя бы одну строку правильного формата. Если файл пустой, или корректных строк не обнаружено, то процедура очистки старых значений клиентских кодов перед импортом из файла не выполняется;
- существование шаблона комиссии в настройках Дилерской библиотеки. В случае его отсутствия изменения в настройках шаблонов не производятся, пропущенные коды клиентов фиксируются в отчете о результатах импорта;
- соответствие кода клиента какому-либо из других шаблонов. Если код клиента входил в другой шаблон, то он будет удален из него и включен в шаблон, указанный для него в файле импорта. Если код клиента не входил ни в один из шаблонов, но для него была настроена индивидуальная комиссия, то он будет включен в указанный шаблон.

После завершения импорта появится сообщение о результате выполнения:

```
Всего обработано X клиентов. Включены в шаблоны Y клиентов. Переведены в другие
шаблоны Z клиентов
```

В случае обнаружения в файле несуществующих шаблонов, в сообщении появится строка вида:

```
Было пропущено N клиентских кодов, так как указанные для них шаблоны не найдены:
[перечень кодов клиентов]
```

10.2 Формат файла для импорта соответствий

Файл имеет текстовый формат (*.txt) и содержит строки вида:

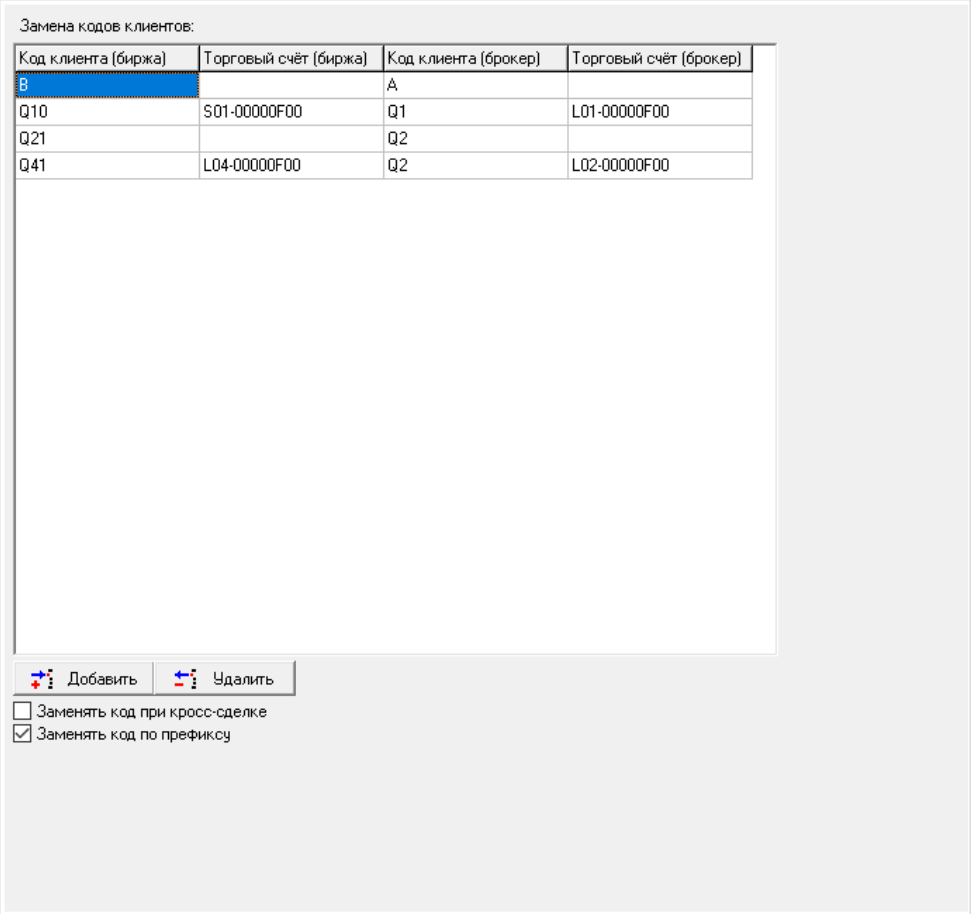
```
<Код_клиента>=<Код_шаблона>
```

Например:

```
12303=Template3
```

> **Указанный код шаблона по комиссии должен соответствовать коду из секции [cl<КодШаблона>_Client_Template] в файле deallib.ini.**

11.Клиенты / Замена кодов



Параметр	Назначение
Замена кодов клиентов	Замена кодов и торговых счетов в заявках клиентов при их отправке в торговую систему и при расчете лимитов клиентов по инструментам и денежным средствам. Пользователям, для которых настраивается замена, нужно указывать в правах оба кода, но лимиты на второй код устанавливать не требуется. Если требуется замена только кода клиента, то поля «Торговый счёт (биржа)» и «Торговый счёт (брокер)» не заполняются. Если требуется замена только торгового счета, в полях «Код клиента (биржа)» и «Код клиента (брокер)» указывается один и тот же код клиента. Новое соответствие добавляется нажатием кнопки «Добавить»
_ Код клиента (биржа)	Вспомогательный код, который при расчете лимитов заменяется сервером на код клиента. На этот код клиента лимиты устанавливать не нужно. Этот же код сервер использует при формировании заявки для совершения кросс-сделки

Параметр	Назначение
_ Торговый счёт (биржа)	Вспомогательный торговый счет, который при расчете лимитов заменяется сервером на торговый счет клиента. На этот счёт лимиты устанавливать не нужно. Этот же счёт сервер использует при формировании заявки для совершения кросс-сделки. Поле обязательно для заполнения, если заполнено поле «Торговый счёт (брокер)»
_ Код клиента (брокер)	Основной рабочий код клиента. На этот код брокером на сервере QUIK устанавливаются лимиты по инструментам и денежным средствам. Этот код клиент указывает в своих заявках
_ Торговый счёт (брокер)	Основной рабочий торговый счет клиента. На этот торговый счет брокером на сервере QUIK устанавливаются лимиты по инструментам и денежным средствам. Этот торговый счет клиент указывает в своих заявках. Поле обязательно для заполнения, если заполнено поле «Торговый счёт (биржа)»
Заменять код при кросс-сделке	Включение этой опции при наличии соответствующей настройки в шлюзе к торговой системе позволяет заключать кросс-сделки, когда покупатель и продавец фактически являются одним лицом. Обе заявки, на покупку и на продажу, подаются с основным рабочим кодом клиента (указанным в колонке «Код клиента (брокер)»). При получении от торговой системы сообщения об отклонении заявки, приводящей к кросс-сделке, сервер QUIK автоматически подаёт заявку с теми же параметрами, что и отклонённая, но со вспомогательным кодом клиента (из колонки «Код клиента (биржа)»). В результате, в торговой системе формально заключается сделка с участием заявок с разными клиентскими кодами, а на сервере QUIK обе заявки и сделка обсчитываются фактически на одном клиентском коде. Замена кодов при кросс-сделке может выполняться не для всех инструментов, а только для определенного списка. Этот список настраивается на странице «Другие параметры» (см. п. 5)
Заменять код по префиксу	Разрешить замену кодов клиентов с использованием префиксов. В этом случае символы, прописанные в колонках «Код клиента (биржа)» и «Код клиента (брокер)» расцениваются сервером как префикс (первые символы) клиентских кодов. Например, при включенной опции и настроенной замене A на B – алгоритм замены кодов будет исполняться не только для пары счетов A и B, но для любой пары счетов, в кодах которых эти символы будут идти первыми: _ A123 и B123 _ A/10 и B/10 _ A_cde и B_cde, и т.п.

Параметр	Назначение
	Если флажок отключен, замена будет производиться только при строгом соответствии кода, указанного в заявке (в нашем примере – для пары A и B, но ни для каких других)

Примеры замены кода клиента

1. Замена кодов клиентов при кросс-сделке.

Клиент выставляет заявку на покупку 1 лота LKOH по 2 000 руб., указывая в заявке клиентский код A. Сервер QUIK проверяет достаточность лимитов для этого клиентского кода и затем отправляет заявку в торговую систему. Далее клиент выставляет заявку на продажу 1 лота LKOH по 2 000 руб., указывая в ней также код клиента A, которая также проходит проверку лимитов на сервере, но после отправки в торговую систему, она отклоняется как приводящая к кросс-сделке (с первой заявкой). Сервер QUIK, получив сообщение о кросс-сделке, формирует новую заявку, у которой параметры совпадают с параметрами отклонённой заявки (продажа 1 лота LKOH по цене 2 000 руб.), а код клиента A заменён на вспомогательный код B, и снова отправляет заявку в торговую систему.

В Таблице заявок после этого будет исполненная заявка на покупку 1 лота LKOH по 2 000 руб. по коду A, снятая заявка на продажу по коду A и исполненная заявка на продажу 1 лота LKOH по 2 000 руб. по коду B. В Таблице сделок будет сделка на покупку 1 лота LKOH по 2 000 руб. по коду A и сделка на продажу 1 лота LKOH по 2 000 руб. по коду B. И все эти заявки и сделки будут обсчитаны на лимитах, установленных для клиентского кода A.

В результате, лимиты клиента A по инструментам и денежным средствам не изменятся (он купил 1 лот и продал 1 лот), не считая комиссии, которая будет списана за обе совершённые сделки.

2. Замена клиентских кодов.

Если опция «Заменять код при кросс-сделке» отключена, настройка описываемой секции позволяет учитывать операции, совершённые по двум кодам клиента на лимитах, установленных на один код. Подмена кода в заявке и перевыставление заявок при таких настройках не производятся.

Предположим, что на сервере есть заявка и сделка на покупку 10 лотов LKOH по 2 000 руб. с кодом клиента A, и есть заявка и сделка на продажу 2 лотов LKOH по 2 500 руб. с кодом клиента B. Обе заявки и обе сделки, при текущих настройках, будут обсчитаны на лимитах клиента A – в результате этих операций на лимит клиента A будет добавлено 8 лотов LKOH, а с денежного будет списано 15 000 руб., не считая комиссии.

Примеры замены кода клиента и торгового счета

1. Настроена замена кода клиента между основным Q1 и дополнительным Q10 и торгового счета между основным L01-00000F00 и дополнительным S01-00000F00.

   Пользователь подает транзакцию по коду клиента Q1 и торговому счету L01-00000F00. Если торговая система отвергает транзакцию как попытку заключения кросс-сделки, и используется замена кода по кросс-сделке, то сервер заменяет код клиента Q1 на код Q10, а торговый счет L01-00000F00 на S01-00000F00.

   Если подается транзакция по коду Q1 и торговому счету L02-00000F00, то при определении попытки осуществления кросс-сделки замена не производится, так как для такого сочетания параметров замены не настроено.

2. Настроена замена кода клиента между основным Q2 и дополнительным Q21. Также настроена замена кода клиента между основным Q2 и дополнительным Q41 и торгового счета между основным L02-00000F00 и дополнительным L04-00000F00.

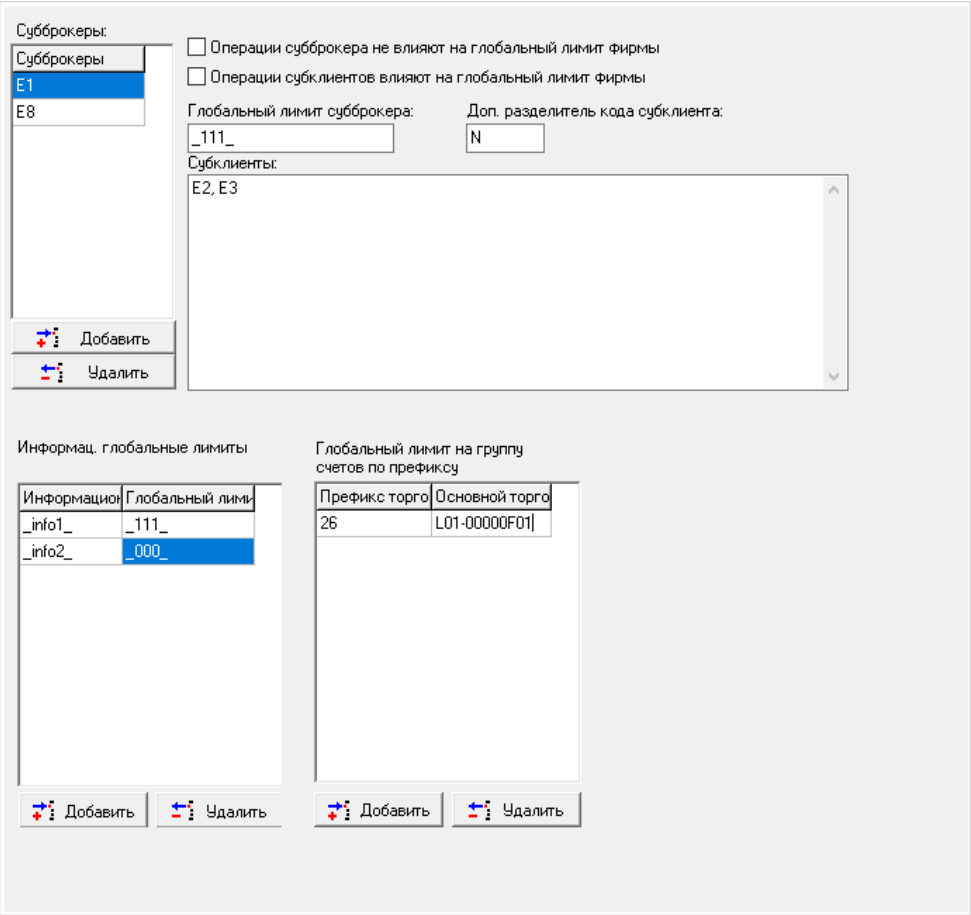
   Пользователь подает транзакцию по коду клиента Q2 и торговому счету L01-00000F00.

   Если торговая система отвергает транзакцию как попытку заключения кросс-сделки, и используется замена кода по кросс-сделке, то сервер заменяет только код клиента Q2 на Q21, так как торговый счет в настройке замены (L02-00000F00) не совпадает с указанным в поручении (L01-00000F00).

Произведенные изменения на данной странице вступают в силу после рестарта сервера QUIK (перезагрузки Библиотеки расчета лимитов недостаточно).

12.Клиенты / Субброкеры

Данная страница предназначена для настройки схемы субадминистрирования.



Параметр	Назначение
Субброкеры	Список кодов субадминистраторов
*Операции субброкера не влияют на глобальный лимит фирмы	Исключение лимита данного субброкера из расчета глобального лимита фирмы-дилера. Операции такого субброкера не меняют значения глобального лимита фирмы
*Операции субклиентов влияют на глобальный лимит фирмы	Добавление лимита субклиентов выбранного субброкера в расчёт глобального лимита фирмы-дилера. Операции такого субклиента влияют на значение глобального лимита фирмы
Глобальный лимит субброкера	Код глобального лимита субброкера. Например, можно указать глобальный лимит «_W2_» для субброкера с кодом «W2». Поручения клиентов субброкера будут проверяться на достаточность средств по назначенным им индивидуальным лимитам и данному глобальному лимиту субброкера.

Параметр	Назначение
	Если глобальный лимит не задан, то в качестве лимита используется глобальный лимит фирмы
Доп.разделитель кода субклиента	Символ, который интерпретируется как разделитель, если включена опция «Автосоздание клиентов субадмина» на странице «Общие параметры», вкладка «Часть 2». Значение параметра – любой ASCII символ, допустимый в составе клиентского кода или торгового счета на срочном рынке. Например, если указан разделитель «N», то клиент с кодом 896N123 является субклиентом для субадминистратора с кодом 896
Субклиенты	Список кодов клиентов данного субброкера, перечисленных через запятую. Если коды клиентов задаются в формате «код субброкера/код клиента» или «код субброкера_код клиента», то вместо перечисления их вручную можно использовать функцию «Автосоздание клиентов субадмина» на странице «Общие настройки», вкладка «Часть 2»
Информационные глобальные лимиты	Список кодов информационных лимитов и соответствующих им глобальных лимитов. Подробнее о настройке информационных глобальных лимитов см. п. 12.1
Глобальный лимит на группу счетов по префиксу	Возможность установки одного глобального лимита по бумагам на группу торговых счетов, начинающихся с определенного префикса. Например, настройка вида: SPBFUT; L01-00000F00 означает, что операции клиентов по счетам, начинающимся с SPBFUT, будут отражаться на глобальном лимите по торговому счету L01-00000F00. Если торговый счет операции в настройках не обнаруживается, то считается, что <префикс торгового счета> = <основной торговый счет>

Настройка списка «Выделенные глобальные лимиты» не используется.

Комбинацией значений признаков (*) устанавливается схема блокирования средств на глобальном лимите фирмы при выставлении заявок. Возможные варианты приведены в таблице.

	Заявка приводит к совершению маржинальной сделки:		
	по счету субклиента	**по счету субброкера**	**Блокирование средств на глобальном лимите**
Вариант 1:	☐ Операции субброкера не влияют на глобальный лимит фирмы ☐ Операции субклиентов влияют на глобальный лимит фирмы		

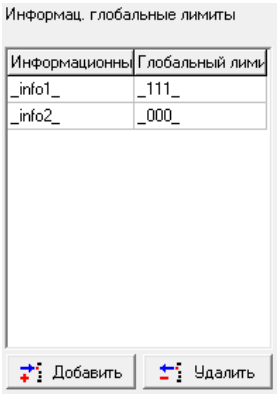
	Заявка приводит к совершению маржинальной сделки: по счету субклиента	по счету субброкера	Блокирование средств на глобальном лимите
Заявка субклиента	Да	Да	На сумму использования кредитных средств **субброкером**
		Нет	Нет
	Нет	Да	На сумму использования кредитных средств **субброкером**
		Нет	Нет
Заявка субброкера	—	Да	На сумму использования кредитных средств **субброкером**
Вариант 2:	☐ Операции субброкера не влияют на глобальный лимит фирмы ☑ Операции субклиентов влияют на глобальный лимит фирмы		
Заявка субклиента	Да	Да	На сумму использования кредитных средств **субклиентом +** на сумму использования кредитных средств **субброкером**
		Нет	На сумму использования кредитных средств **субклиентом**
	Нет	Да	На сумму использования кредитных средств **субброкером**
		Нет	Нет
Заявка субброкера	—	Да	На сумму использования кредитных средств **субброкером**
Вариант 3:	☑ Операции субброкера не влияют на глобальный лимит фирмы ☐ Операции субклиентов влияют на глобальный лимит фирмы		
Заявка субклиента	Да	Да	Нет
		Нет	Нет
	Нет	Да	Нет**
		Нет	Нет
Заявка субброкера	—	Да	Нет**
Вариант 4:	☑ Операции субброкера не влияют на глобальный лимит фирмы ☑ Операции субклиентов влияют на глобальный лимит фирмы		

	Заявка приводит к совершению маржинальной сделки:		
	по счету субклиента	**по счету субброкера**	**Блокирование средств на глобальном лимите**
Заявка субклиента	Да	Да	На сумму использования кредитных средств **субклиентом**
		Нет	На сумму использования кредитных средств **субклиентом**
	Нет	Да	Нет**
		Нет	Нет
Заявка субброкера	—	Да	Нет**

** – если на глобальном лимите не отражается маржинальная задолженность субброкера, отрицательное значение глобального лимита фирмы не является препятствием для совершения клиентами субброкера маржинальных сделок, в размере положительного остатка на глобальном лимите субброкера.

12.1 Информационные глобальные лимиты

Информационный глобальный лимит (ИГЛ) – остаток ресурсов на глобальном лимите, отображаемый для клиентов в информационном режиме, начиная с заданного брокером порогового значения. Представляет собой фиктивный клиентский код, привязанный с помощью настроек системы к глобальному лимиту. Клиенты могут наблюдать значения ИГЛ в виде лимитов, заданных для указанного фиктивного клиентского кода, в «Таблице лимитов по бумагам» и в «Таблице лимитов по денежным средствам».



Способ настройки ИГЛ:

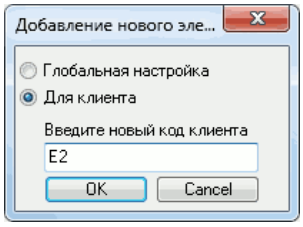
1. На вкладке «Информационные глобальные лимиты» раздела «Клиенты/Субброкеры» задайте соответствие между глобальным лимитом субброкера или фирмы и информационным лимитом. Глобальный лимит субброкера должен быть задан предварительно в поле «Глобальный лимит субброкера» (см. п. 12).
2. В разделе «Другие параметры» внесите название информационного лимита в список «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций».
3. В настройках всех пользователей, которым планируется предоставить возможность просмотра ИГЛ, добавьте в список «Коды клиентов у дилера (через ,)» код клиента, соответствующий ИГЛ. Операцию нужно повторить для каждого класса, по которому нужно отражать значения информационных лимитов.
4. Для кода клиента, соответствующего ИГЛ, назначьте лимиты по бумагам и денежным средствам, указав в качестве «Входящего остатка» пороговое значение, начиная с которого будет отображаться изменение остатка лимита.

   Текущее значение информационного глобального лимита будет отображаться в поле «Текущий остаток». Если значение глобального остатка больше порогового значения, то в данном поле будет отображаться пороговое значение.

> **Для отдельного глобального лимита можно задать несколько информационных лимитов, которые затем присваиваются разным клиентам данного субброкера. Таким образом, разным клиентам одного субброкера можно задать разные пороговые значения по лимитам.**

13.Клиенты / Настройки «плеча»

На этой странице настраиваются параметры использования клиентами кредитного «плеча» при маржинальной торговле.

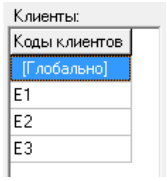


Настройка осуществляется по следующему принципу:

- В список «Клиенты» добавляются коды клиентов, в отношении которых действуют настройки:
  - «Глобальная настройка» – установка глобальных настроек маржинального кредитования. В список кодов клиентов может быть добавлен только один элемент «[Глобально]»;

- «Для клиента» – установка индивидуальных настроек маржинального кредитования.

- Для просмотра и настройки ограничений нужно выбрать клиента из списка и вид лимита. На экране отобразится текущее состояние его настроек для выбранного вида лимита. Для просмотра и установки глобальных настроек маржинального кредитования в разрезе лимитов выберите значение «[Глобально]» из списка кодов клиентов и вид лимита.



Ограничения можно задать вручную, или применить шаблон настроек, сформированный на странице «Клиенты/Шаблоны/По плечу».

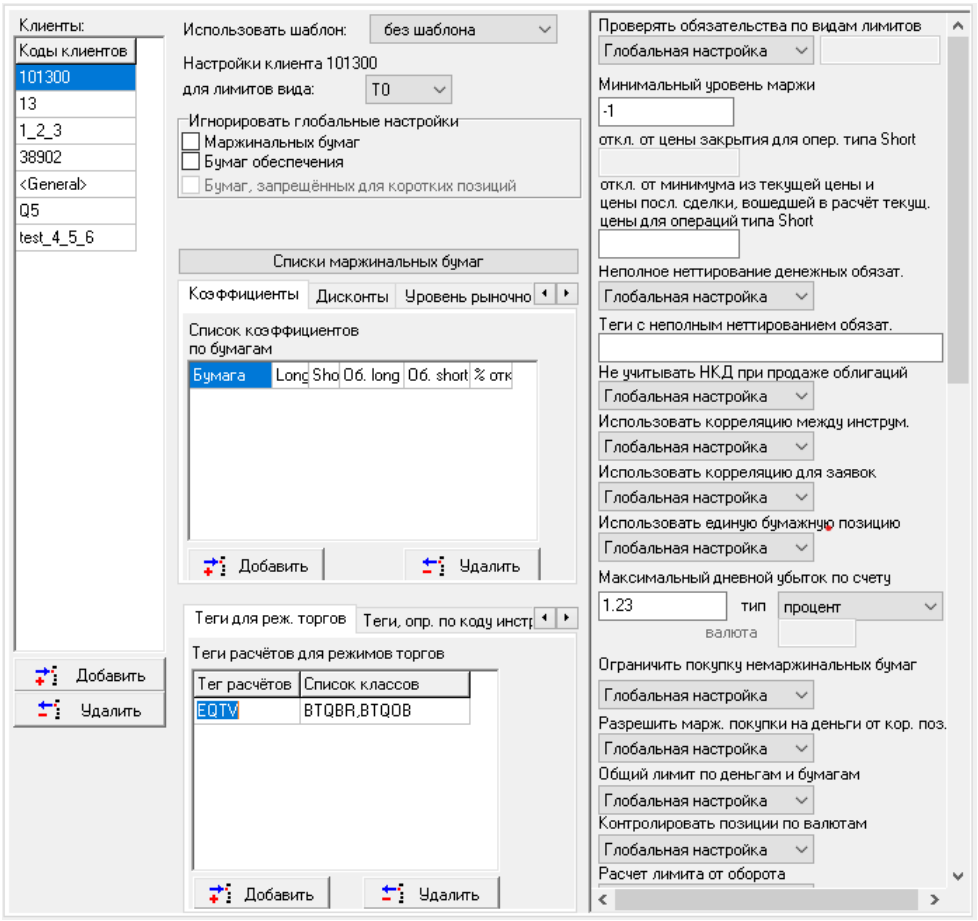
> **При установке глобальных настроек маржинального кредитования ограничения задаются вручную.**

Настройки использования «плеча» могут быть указаны для группы клиентов по префиксу кода клиента. При настройке «плеча» по префиксу кода использование шаблонов недопустимо, то есть должно быть выбрано значение «без шаблона». Если указан код клиента «E*», то настройки распространяются на всех клиентов, код клиента у которых начинается с символа «E», за исключением тех, которым заданы настройки на код клиента.

Приоритет использования параметров:

1. Настройки по шаблону, в котором включена настройка выбора маржинальных параметров по значению плеча (см. «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"», п. 15).
2. Индивидуальные настройки «Для клиента», заданные на данной вкладке («Настройки "плеча"»), или по шаблону для нескольких кодов клиентов, заданному на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"» (см. п. 15).
3. Настройки для группы клиентов, заданные на данной вкладке («Настройки "плеча"») по префиксу кода клиента.
4. Глобальные настройки, заданные на данной вкладке («Настройки "плеча"»).
5. Глобальная настройка, заданная на вкладке «Использование "плеча"» (см. п. 22) или на вкладке «Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23).

Если индивидуальная настройка клиента для вида лимита, не равного T0 (T1, T2 и т.д.), не содержит значения или содержит значение «Глобальная настройка», то используется значение настройки для вида лимита T0 для данного клиента.



Параметр	Назначение
Клиенты	Список кодов клиентов, имеющих настройки. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1)
Использовать шаблон	Выбор шаблона для применения настроек к данному клиенту. Шаблоны формируются на странице «Клиенты/Шаблоны/По «плечу». Для ручной настройки параметров используйте значение «без шаблона». При глобальной настройке параметров поле недоступно для редактирования
Настройки клиента для лимитов вида	Все настройки раздела распространяются на операции, «привязанные» к указанному виду лимита. Такая привязка осуществляется по режиму торгов операции и определяется настройкой «Привязка классов к видам лимитов». Для всех значений данной настройки значения параметров «Проверять обязательства по видам лимитов» и «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов» должны быть одинаковыми

Параметр	Назначение
Игнорировать глобальные настройки	Отключает использование для данного клиента списков бумаг, заданных «по умолчанию» для всех клиентов. Эти списки задаются на странице «Ограничения на / Использование плеча». Настройки из данного блока предназначены для игнорирования ограничений на тип маржинальности бумаг (маржинальные бумаги, бумаги обеспечения и бумаги, запрещенные на открытие коротких позиций), установленных для других клиентов. Включение каждой опции клиенту означает, что все доступные ему бумаги будут иметь этот тип маржинальности. Настроить индивидуальный список бумаг при включенной опции для клиента невозможно
_ Маржинальных бумаг	Игнорировать список бумаг, разрешенных для маржинальной торговли всем клиентам
_ Бумаг обеспечения	Игнорировать список бумаг, принимаемых в обеспечение маржинальных сделок всех клиентов
_ Бумаг, запрещенных для коротких позиций	Игнорировать список бумаг, запрещенных для операций «short» всем клиентам
Списки маржинальных бумаг	Открытие формы для настройки списка маржинальных бумаг (описание приведено в п. 32)
Вкладка «Коэффициенты»	
Список коэффициентов по бумагам	Настройка коэффициентов кредитования ресурсами при продаже или покупке соответствующего инструмента, а также для задания максимального размера обеспечения по данной бумаге. Допускается указание в качестве инструмента кода валюты. При указании такой настройки активы клиента, находящиеся в денежном лимите («остаток» минус «заблокировано»), номинированном в заданной валюте, дисконтируются на указанный коэффициент. Отдельный коэффициент может быть задан для длинной и для короткой позиции. В отличие от настройки для ценных бумаг, дисконтирование денежного лимита не ограничивается минимальным значением для лонгов и максимальным для шортов. Дисконтированные значения денежного остатка (баланса) на клиентском месте НЕ показываются, а учитываются лишь в расчётах при лимитировании заявок
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента
_ Long	Коэффициент оценки длинной позиции по данному инструменту. Значение по умолчанию: «1»
_ Short	Коэффициент оценки короткой позиции по данному инструменту. Значение по умолчанию: «1»

Параметр	Назначение
_ Об. Long	Максимальный размер позиции по данной бумаге, учитываемый в обеспечении маржинальных сделок, в валюте инструмента
_ Об. Short	Максимальный размер короткой позиции по данной бумаге, в валюте инструмента
_ % откл. диск.	Параметр контроля условий для заявок в режиме РЕПО-М, устанавливающий: Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и нижним дисконтом для заявок на покупку; Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и верхним дисконтом для заявок на продажу
Вкладка «Дисконты»	
Список дисконтов по бумагам	Установка дисконтов кредитования ресурсами при продаже/ покупке по выбранной бумаге. Настройка применяется для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Подробнее см. в комментарии к данной настройке в п. 13
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента. Для фьючерсов при использовании схемы «МД+» в качестве значения может быть задан префикс в формате «<префикс>*»
_ Д long	Значение дисконта брокера для длинной позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ Д short	Значение дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ Д min long	Значение минимального дисконта брокера для длинной позиции по данному инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ Д min short	Значение минимального дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ К long	Коэффициент ставки риска длинной позиции по данному инструменту. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13

Параметр	Назначение
_ K short	Коэффициент ставки риска короткой позиции по данному инструменту. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
Вкладка «Уровень рыночного риска»	
Уровень ставки рыночного риска по классам	Диапазон используемых дисконтов КЦ в разрезе классов оценки. Настройка доступна только для лимитов вида Т0. Если класс, в котором оценивается инструмент, не добавлен в данную настройку, то для него используется настройка «Уровень ставки рыночного риска»
_ Уровень ставки	Номер диапазона дисконтов КЦ. Возможные значения: от 0 до 255
_ Список классов	Список классов через запятую
Вкладка «Теги для реж. торгов»	
Теги расчётов для режимов торгов	Настройка соответствия тегов расчетов и классов инструментов. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой «Теги расчётов для режимов торгов» на странице «Другие параметры» (см. п. 5)
_ Тег расчётов	Тег расчётов
_ Список классов	Список классов инструментов для данного тега расчетов, разделенный запятыми
Вкладка «Теги, опр. по коду инстр.»	
Теги, определяемые по коду инструмента	Настройка соответствия тегов расчетов и кодов инструментов. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Доп. теги расчетов» (см. п. 17)
_ Теги	Список тегов
_ Список инструментов	Коды инструментов, разделенные запятыми, позиции по которым включаются в расчет входящего и текущего лимитов по заданному тегу расчетов, например, «LKOH, RTKM»
Вкладка «Корреляция между инструм.»	
Корреляция между инструм.	Индивидуальные настройки зависимостей между инструментами. Используются, если параметр «Использовать корреляцию между инструментами» имеет значение «Да». Параметры задаются аналогично глобальной настройке, расположенной на странице «Инструменты» (см. п. 8.1)
Вкладка «Счета един. бум. позиции»	

Параметр	Назначение
Счета един. бум. позиции	Настройка предназначена для суммирования позиций по инструментам (с учетом знака) с разных торговых счетов при расчёте покупательной способности. Настройки используются, если параметру «Использовать единую бумажную позицию» присвоено значение «Да»
_ Теги	Тег расчетов, например, «EQTV»
_ Список счетов	Список торговых счетов через запятую. Допустимо использование префикса, например «L01*»
Вкладка «Прив. классов к видам лимитов»	
Привязка классов к видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия между видами лимитов и классами ценных бумаг для определения вида лимита текущей операции, аналогично глобальной настройке на странице «Общие настройки библиотеки. Часть 5» (см. п. 4.5). Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «T», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания. Значение по умолчанию: «T0»
_ Классы	Список классов инструментов, перечисленных через запятую
Вкладка «Прив. инстр. к видам лимитов»	
Привязка инструментов к видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия инструмента и вида лимита, начиная с которого отражается операция, аналогично глобальной настройке, описанной на странице «Инструменты» (см. п. 8.2). Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «T», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания
_ Инструменты	Список инструментов, перечисленных через запятую
Вкладка «Прив. код. расч. к класс. и вид. лим.»	
Привязка кодов расч. к классам и видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия кодов расчетов виду лимита и классам, аналогично глобальной настройке, описанной на вкладке «Классы» (см. п. 7).

Параметр	Назначение
	Настройка используется только для адресных режимов торгов и режимов РЕПО с ЦК. Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «T», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания
_ Классы	Список классов инструментов, перечисленных через запятую
_ Коды расчётов	Список кодов расчётов, перечисленных через запятую
Вкладка «Классы со списанием средств в T0»	
Классы со списанием средств в T0	Настройка используется для операций, которые учитываются на видах лимита, отличных от T0. Если класс операции указан в настройке, то по сделкам, совершаемым клиентом с инструментами этого класса, блокировка и списание активов дополнительно производятся на всех предыдущих видах лимита, начиная с T0. Зачисление активов на дополнительные виды лимита при этом не производится. Например, на видах лимита, предшествующих тем, где учитываются операции, для сделок покупки производится только списание денежных средств с позиции по деньгам (без учета комиссий брокера и торговой системы), а для сделок продажи – только списание количества в сделке с позиции по инструменту. Допускается указывать только классы спот- и РПС-операций на фондовом рынке. Настройку нельзя использовать совместно с настройкой «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов», если предполагается совершение операций с расчетами в T0
Вкладка «Инструменты без валютного риска»	
Инструменты без валютного риска	Классы и инструменты, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Настройка выполняется для лимитов вида T0, но ее значение учитывается для операций с любым видом лимита
_ Классы	Список классов инструментов, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить». При этом могут быть выбраны все классы (при выборе этого варианта в списке появится значение <ALL>) или наименование из списка.

Параметр	Назначение
	В качестве классов следует указывать только те, в которых может оцениваться портфель (перечисленные в настройке «Список классов для оценки портфеля», см. п. 7)
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ Все инструменты	Все инструменты класса
_ По списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми
Вкладка «Учет операций РЕПО»	
Классы адресного РЕПО с учетом второй части по сделке	Список классов РЕПО-М и адресного РЕПО с ЦК, для которых по заявке и сделке на позициях клиента, по сроку расчетов, соответствующих второй части, учитываются комиссия и разница между суммой выкупа РЕПО и суммой РЕПО. Используемые сроки расчетов (виды лимита) должны покрывать обе части сделки. Не поддерживается возможность отказа от исполнения сделки РЕПО: в случае отказа от исполнения брокеру необходимо скорректировать лимиты. Настройка отменяет действие настроек «Игнорировать срок расчетов РЕПО с ЦК» и «Рассчитывать обязательства РЕПО/РПС по всем видам лимитов»
Вкладка «Оценка портфеля»	
Список классов для оценки портфеля	Список классов инструментов (через запятую), используемых для оценки активов клиентов, и очередность их использования. Может применяться для установки приоритета какого-либо класса, если одни и те же инструменты торгуются в нескольких классах – приоритет классов в списке уменьшается слева направо. Данный список классов ограничивает отображение инструментов в таблице «Купить/продать» в Рабочем месте QUIK. Настройка имеет более высокий приоритет относительно глобальной настройки, задаваемой на странице «Классы» (см. п. 7). Если настройка не задана, то используется список классов, формируемый глобальными настройками «Список классов для оценки портфеля» и «Дополнительные классы для оценки портфеля». Настройка не учитывается при расчете портфельного гарантийного обеспечения
Другие настройки	
Проверять обязательства по видам лимитов	Настройка проверки обязательств по видам лимитов
_ Да	Проверка обязательств для указанных сроков расчетов

Параметр	Назначение
_ Нет	Проверка обязательств только по лимиту операции
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Общие настройки библиотеки. Часть 5»
Минимальный уровень маржи	Минимальный уровень маржи, контролируемый для данного клиента при динамической корректировке лимитов. Если корректировка приводит к снижению уровня маржи ниже минимального уровня, то данная корректировка будет отвергнута сервером
Откл. от цены закрытия для опер. типа Short	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от цены закрытия предыдущей торговой сессии. Если значение отсутствует или отрицательно, то используется глобальная настройка. Нулевое значение отключает все ограничения цены операций «Short» для выбранного клиента (то есть проверка отклонения от текущей цены и от цены последней сделки для выбранного клиента также не будет производиться). Настройка не применяется для списка классов, по которым не будет осуществляться проверка ограничений на цены в заявках на открытие коротких позиций, указанных на странице «Ограничения на…/ Использование плеча»
Откл. от минимума из текущей цены и цены посл. сделки, вошедшей в расчет текущ. цены, для операций типа Short	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от наименьшей из двух цен: официальной текущей цены, сообщаемой торговой системой биржи, цены последней сделки, вошедшей в расчет текущей цены. Отклонение указывается в процентах. Если значение отрицательно, то проверка не выполняется. Если значение отсутствует, то используется глобальная настройка
Неполное неттирование денежных обязат.	Настройка работает при наличии у клиента нескольких денежных лимитов, текущие остатки которых суммируются при определении покупательной способности. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования» и «Клиенты / Шаблоны / По «плечу»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного на странице «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Отключено	Учёт параметра не производится. Значение по умолчанию
_ Только денег	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, клиенту будет увеличена маржинальная задолженность с целью ограничения возможности увеличивать

Параметр	Назначение
	текущие остатки на одних денежных лимитах за счёт увеличения маржинальной задолженности на других
_ Денег с учетом бумаг	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, активы клиента будут уменьшены на величину дисконта, примененного к задолженности по валюте, превышающей обеспечение в этой же валюте
Теги с неполным неттированием обязательств	Список тегов расчетов через запятую, при операциях по которым применяется неполное неттирование денежных обязательств. Если настройка не задана, то неполное неттирование денежных обязательств применяется к операциям по всем тегам расчетов, иначе – только по указанным в списке. Поле доступно для редактирования, если значение настройки «Неполное неттирование денежных обязат.» отлично от «Глобальная настройка» и «Отключено»
Не учитывать НКД при продаже облигаций	Разрешает не учитывать Накопленный купонный доход (НКД), возвращаемый продавцу при продаже облигаций, не увеличивая покупательную способность клиента на его денежном лимите при совершении сделки
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках». Часть 1 (см. п. 4.1)
Использовать корреляцию между инструм.	Включить для данного клиента индивидуальные настройки зависимостей между инструментами на разных рынках, используемые для расчета покупательной способности
_ Да	Использование корреляции разрешено, настройки зависимостей установлены на вкладке «Корреляция между инструм» (см. п. 13). Если список не настроен (пустой), то это равносильно запрету использования
_ Нет	Использование корреляции запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Инструменты» (см. п. 8)
Использовать корреляцию для заявок	Включить для данного клиента учёт корреляции открытых позиций и активных заявок с выставляемой заявкой при проверке достаточности средств. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу», для которых включена настройка «Использовать корреляцию между инструментами»

Параметр	Назначение
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
Использовать единую бумажную позицию	Выбор режима учета единой бумажной позиции для клиента
_ Да	Использовать настройки, указанные на вкладке «Счета един. бум. позиции»
_ Нет	Не использовать настройки единой бумажной позиции
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Клиенты/Доп.теги расчетов» (см. п. 17)
Максимальный дневной убыток по счету	Настройка максимально допустимого значения дневного убытка по счету клиента. Значение задается в виде фиксированной суммы с указанием валюты или в виде процента от входящих средств клиента. При проведении операции происходит сравнение максимально допустимого значения убытка с разностью оценок входящих и текущих средств по счету клиента. Если убыток по счету больше допустимого, то операция запрещается (кроме операций закрытия позиций). При проведении оценки убытков все бумажные и денежные позиции клиента складываются и приводятся к валюте, в которой задано ограничение. Если ограничение задано в процентах, то пересчет происходит в «основную» валюту денежной позиции клиента. Входящие позиции по бумагам оцениваются по ценам закрытия, текущие позиции – по цене последней сделки. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу». При операциях ввода / вывода средств внутри дня, проведенных в виде коррекции текущих остатков, торговые операции могут становиться доступными или недоступными для клиента в зависимости от текущего значения убытков по счету клиента
_ значение	Допустимое значение убытка по счету в течение дня
_ тип ограничения	Выбор типа ограничения. Возможные значения: _ процент; _ фиксированный
_ валюта ограничения	Ввод кода валюты ограничения, например «SUR». Поле доступно, если тип ограничения – «фиксированный»

Параметр	Назначение
Ограничить покупку немаржинальных бумаг	Настройка ограничения на операции с немаржинальными бумагами:
_ Да	Используется ограничение на покупку немаржинальных бумаг в пределах остатка собственных средств, оставшихся свободными после покупки маржинальных бумаг. В качестве остатка собственных средств в расчет принимается только значение с денежного лимита по тегу и валюте текущей операции
_ Нет	Покупка маржинальных бумаг расценивается сервером как операция с «плечом», использующая частично собственные и частично заемные средства. Таким образом, при покупке клиентом маржинальных бумаг на величину всех своих средств у него могут остаться неизрасходованные собственные средства, доступные для покупки немаржинальных бумаг
_ Глобальная настройка	Определяется настройкой параметра «Ограничивать покупку немаржинальных бумаг» на странице «Настройки маржинального кредитования» см. п. 23
Разрешить марж. Покупки на деньги от кор. Поз.	Разрешает использование средств, полученных от открытия коротких позиций, на открытие маржинальных длинных позиций. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу»
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках». Часть 2 (см. п. 4.2)
Общий лимит по деньгам и бумагам	Распространяется на клиентов с типом кредитования «По лимитам». Для включения настройки должна быть отключена проверка операций шорт (см. п. 22. «Ограничения на использование плеча»)
_ Да	Все маржинальные операции в сумме (и покупка на заёмные деньги, и шорт) ограничиваются величиной установленного клиенту денежного лимита. Величина лимитов по бумагам перестает учитываться. При включении настройки также появляются следующие отличия в отображении операций клиента: _ маржинальные операции покупки уменьшают размер текущего денежного остатка на сумму задолженности перед брокером (текущий остаток становится отрицателен при покупке на заёмные средства);

Параметр	Назначение
	_ операции короткой продажи не изменяют отображаемых в таблицах лимитов по деньгам и по бумагам
_ Нет	Не использовать общий лимит по деньгам и бумагам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках», Часть 2 (см. п. 4.2). Выбрано по умолчанию
Контролировать позиции по валютам	Настройка позволяет контролировать максимальные допустимые размеры остатков (лонг, шорт) на денежных лимитах клиента отдельно по каждой валюте. Для корректной работы данной опции класс валютного инструмента должен быть прописан на странице «Классы» в поле «Вести денежные позиции в разрезе валют», а клиент должен иметь тип лимитирования «Лимит на открытую позицию»
_ Да	При включении настройки в таблице «Список коэффициентов по бумагам» можно задать ограничение на максимальный размер коротких и длинных позиций по валютам. Ограничение на длинную и короткую позицию по валюте задается в полях «Об. Long» и «Об. Short» соответственно отдельно для каждой валюты. При этом ограничения на валюту интерпретируется как ограничения на размер текущего остатка по валюте с учётом активных заявок. Оценка остатков на лимитах по бумагам не учитывается. Коэффициенты «Long» и «Short» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» не учитываются
_ Нет	Не контролировать позиции по валютам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
Расчет лимита от оборота	Дополнительный параметр при типе кредитования клиентов «Лимит на открытую позицию»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Нет	Учёт параметра не производится
_ Без возмещения	Установленный клиенту входящий лимит (колонка «входящий лимит» Таблицы денежных лимитов) интерпретируется как лимит на дневной оборот по операциям. В дневном обороте учитываются все сделки клиента по тегу расчётов, на который установлен входящий лимит, без учёта направления, с учётом

Параметр	Назначение
	коэффициента в поле «Long» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» (по умолчанию коэффициент «Long» равен 1). Валюта лимита должна совпадать с «валютой лимитов открытых позиций на инструменте» (настраивается в описываемой странице)
_ С возмещением	При совершении торговых операций, обратных по направлению к ранее совершенным в текущую торговую сессию операциям, значение текущего лимита восстанавливается (увеличивается), на объём совершённой операции, но не более суммы, списанной ранее
Ограничить вывод денежных средств	Настройка ограничения на вывод денежных средств. Действие настройки распространяется на сложные отчеты, если включена настройка «Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов». Действие настройки не распространяется на классы, указанные в параметре «Классы с игнорир. ограничения на вывод ДС»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Клиент может вывести только остаток денежных средств
_ Нет	Могут быть выведены средства в размере, превышающем собственный остаток в пределах свободных средств маржинального портфеля. Например, в схеме «по плечу»: если клиент, имея плечо 1 и 100 рублей на счете, сделает покупку на 90 рублей, то при включенном флажке ему дадут вывести только 10 рублей, а при выключенном – 55 рублей
Классы с игнорир. ограничения на вывод ДС	Список классов, для которых отменяется действие настройки «Ограничить вывод денежных средств». Если для вида лимита, отличного от Т0, список пуст, то используется список классов, заданный для вида лимита Т0 для данного клиента. Если для вида лимита Т0 список тоже пуст, то используется список классов, заданный на странице «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования» независимо от состояния настроек «Ограничить вывод денежных средств» на этой странице и на странице для вида лимита Т0
Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов	Настройка определяет допустимость образования или увеличения задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета. Настройка задается для вида лимита Т0. Используется, если настройка «Ограничить вывод денежных средств» включена

Параметр	Назначение
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Образование или увеличение задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета запрещено
_ Нет	Образование или увеличение задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета разрешено
Ограничить операции на срочном рынке	Настройка позволяет выбирать возможность торговли срочными инструментами в единой денежной позиции либо за счет только остатка собственных средств, либо за счет привлечения дополнительно заемных средств, вплоть до ограничительного уровня маржи
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Операции по покупке и продаже срочных контрактов при использовании модуля единой денежной позиции возможны только за счет собственных денежных средств клиента
_ Нет	Операции по покупке и продаже срочных контрактов при использовании модуля единой денежной позиции возможны как за счет собственных средств клиента, так и за счет заемных средств клиента при условии, что данные операции не снижают уровень маржи ниже ограничительного
Запрещать открытие коротких позиций при нулевом входящем лимите	Настройка позволяет расширить действие аналогичной глобальной настройки на код клиента, шаблон клиентских кодов, префикс клиентского кода
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	При включении настойки открытие коротких позиций при нулевом входящем лимите невозможно
_ Нет	Учёт параметра не производится
Уровень ставки рыночного риска	Значение уровня ставки риска дисконтов КЦ. Возможные значения: неотрицательные целые числа. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Уровень ставки рыночного риска по классам» (см. п. 13)

Параметр	Назначение
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Заданное значение	Поле для ввода значения уровня ставки риска. Значение по умолчанию: «3». Допустимая область значений: положительные целые числа
Использовать настроенные дисконты	Включение настройки позволяет брать в качестве эффективных дисконтов только собственные дисконты, настроенные в разделе «Дисконты». Дисконты КЦ в этом случае игнорируются. Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ
Параметры корректировки минимальных дисконтов	Параметры, позволяющие клиенту задание коэффициентов, корректирующих значения минимальных дисконтов
_ Long	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по длинной позиции. Допустимая область значений: [0;1]
_ Short	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по короткой позиции. Допустимая область значений: [0;1]
Использовать дисконты КЦ	Настройка влияет на порядок определения эффективных дисконтов по инструменту. Использование данной настройки возможно совместно с настройкой «Использовать настроенные дисконты». Путем комбинации данных настроек устанавливается необходимый брокеру порядок выбора эффективных дисконтов в различных ситуациях. Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ
Доп. учитывать комиссии на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссии брокера и торговой системы по таким операциям учитываются не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов лимитов, то эти комиссии учитываются также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет больший приоритет, чем настройка «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках». Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию

Параметр	Назначение
_ Да	Учет комиссии операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0
_ Нет	Учет не производится
Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссия торговой системы по таким операциям учитывается не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом комиссия брокера учитывается только на лимите операции. Если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов лимитов, то комиссия торговой системы учитывается также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Доп. учитывать комиссии на лимите Т0»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Учет комиссии торговой системы по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0
_ Нет	Учет не производится
Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах	Используется, если включена хотя бы одна из настроек – «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» или «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0». Настройка влияет на проверку покупательной способности для клиентов с типом кредитования «по плечу», «по дисконтам» и «МД+». При включенной настройке заявки отвергаются, если, с учетом комиссии по выставляемой заявке, оценка текущих активов клиента на лимите Т0 становится отрицательной. При отключенной настройке для клиентов с типом кредитования «по плечу» блокировка и списание комиссии на лимите Т0 проверяется до ограничительного уровня маржи на лимите Т0, а для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» проверяется, что стоимость портфеля превышает значение вычисляемой скорректированной маржи
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Проверка комиссии на лимите Т0
_ Нет	Проверка не производится
Игнорировать проверку комиссии в Т0 при закрытии позиции	Настройка требует включения настройки «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» и перекрывает действие

Параметр	Назначение
	настройки «Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах» для заявок на закрытие позиции. Поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке отключается проверка достаточности средств под комиссию на лимите Т0 при проверке заявок, сокращающих модуль позиции по инструменту на лимите по плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов»). При этом блокировка комиссии на лимите Т0 по заявке и ее списание по сделке все равно выполняется
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках». Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Отключение проверки комиссии на лимите Т0
_ Нет	Настройка не используется
Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится по списку лимитов, перечисленных в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов», начиная с вида лимита, к которому привязан инструмент, класс или код расчётов. Для текущего проверяемого вида лимита используются наборы дисконтов, если такие дисконты настроены (можно использовать разные дисконты в разрезе видов лимитов). При отключенной настройке, по умолчанию, контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится только на лимите плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов»)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Выполнить проверку
_ Нет	Проверка не производится
Запрет маржинальных покупок	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке сервер QUIK отклоняет заявки на покупку маржинальных бумаг, перечисленных в списке «Обеспечение» (см. п. 32.1), если объем заявки превышает текущий свободный остаток собственных денежных средств

Параметр	Назначение
	клиента по тегу и валюте расчетов. При отключенной настройке такая проверка не производится
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Запретить маржинальные покупки
_ Нет	Разрешить маржинальные покупки
Использовать портфельное ГО	Включение / выключение режима ПГО для отдельных клиентов (см. п. 1.1 Описания настроек ПГО)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Учет операций срочного рынка» (см. п. 18). Значение по умолчанию
_ Да	Использовать портфельное ГО
_ Нет	Не использовать портфельное ГО
Проверять продажу актива за немаржинальную валюту как вывод средств	Настройка поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Включение настройки позволяет запретить выставление заявок на продажу актива, входящего в обеспечение, если исполнение таких заявок приводит к ситуации УДС < 1. Требование запрета распространяется на такие продажи актива, в результате которых в портфель клиента приходит немаржинальная валюта
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется
Контроль операций РЕПО/РПС по отчету на исполн.	Включает проверку операций РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S0» и «B0») на лимите T0 при подаче отчета на исполнение первой части (для сделок РЕПО) и отчета на исполнение (для сделок РПС)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется

Параметр	Назначение
Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок	Настройка влияет на операции РЕПО с кодом расчётов S0 и РПС с кодом расчетов B0. Если список «Классы расчета лимитов для внебиржевых заявок» (см. п. 13) содержит значения, то настройка влияет только на операции по классам бумаг, указанным в списке, иначе – на операции всех классов РЕПО и РПС с указанными кодами расчетов. Если выбрано значение «Нет», то проверка достаточности средств на лимите T0 при подаче заявок в указанных режимах не выполняется, проверка и блокировка лимитов осуществляются только на лимитах T1, T2 и т.д. Расчёты по сделке учитываются на лимитах T1, T2 и т.д. сразу при заключении сделки. На лимите T0 проверка, блокировка и списание средств производятся при подаче отчёта по сделке для исполнения и её подтверждении отчётом со стороны партнёра. Если выбрано значение «Да», то на видах лимитов T0, T1, T2 и т.д. проверка и блокировка средств производятся при подаче заявок в указанных режимах. Расчёты по сделке для лимитов T1, T2 и т.д. производятся непосредственно при заключении сделки, а для лимита T0 – при подтверждении обеими сторонами сделки для исполнения
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Общие параметры» в разделе «Общие настройки библиотеки. Часть 3» (см. п. 4.3). Значение по умолчанию
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется
Классы расчета лимитов для внебиржевых заявок	Список классов инструментов (через запятую), по которым осуществляется проверка достаточности средств при подаче заявок РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S*» и «B*»). Проверка осуществляется при включенном флажке «Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок» (см. п. 13). Если список классов не задан, проверка достаточности средств выполняется по всем классам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Классы» (см. п. 7)
_ Заданное значение	Поле для указания списка классов инструментов через запятую
Неттинг риска вал. позиций в скорр. марже	Включение настройки позволяет использовать особую логику учета валютных позиций в скорректированной марже, при которой риск текущей валютной позиции компенсируется за счет учета этого риска в оценке потенциальной позиции по инструменту заявки с большим дисконтом.

Параметр	Назначение
	Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Данный алгоритм не следует использовать для инструментов, которые торгуются в разных режимах торгов в разных валютах. Корректность расчетов при работе с такими инструментами не гарантируется. Данная настройка не поддерживается для операций в режимах торгов, указанных в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы» (см. п. 7)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Неттинг осуществляется
_ Нет	Неттинг не осуществляется
Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме МД+	Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме «МД+». О расчете минимальной маржи см. в Комментарии 3 к п. 23. Значение по умолчанию: «0,5»

Комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам»

Настройка эффективных дисконтов

В схемах ведения позиций **«по дисконтам»** и **«МД+»** разрешение на создание «непокрытой позиции» определяется значениями т.н. «эффективных дисконтов» для конкретного инструмента. Используемый в QUIK термин «эффективные дисконты» фактически соответствует определенному в п.15 Приложения Указаний Банка России от 26.11.2020 № 5636-У термину «значение начальной ставки риска уменьшения или увеличения стоимости (курса) имущества или цены фьючерсного договора». Для каждого инструмента могут быть определены эффективные дисконты для оценки длинной и короткой позиции:

- «Д long», допустимы значения> 0. Значение по умолчанию: «1»;
- «Д short», допустимы значения> 0. Значение по умолчанию: «+∞».

Соответствие значений эффективных дисконтов в QUIK и регламентированных приказом типов инструментов приведено в таблице:

* Тип инструмента	Поведение в QUIK	Обозначение	D long	D short
Неликвидный	Немаржинальная	Нет	-	-

Непокрытая позиция запрещена, положительное значение плановой позиции не принимается равным 0	Лонг	Д	>= 0	-
Ликвидный	Шорт	К	-	< +∞
Ликвидный	Лонг и Шорт	ДК	>= 0	< +∞

* – тип инструмента в соответствии с пп. 3 – 8 Указаний Банка России № 5636-У.

В схемах ведения позиций **«по дисконтам»** и **«МД+»** существуют два способа задания эффективных дисконтов (т.е. участвующих в вычислении покупательной способности по данному клиенту и данному инструменту):

1. Первый способ.

   Заключается в явном указании собственных дисконтов «Д long» и/или «Д short» с одновременным игнорированием дисконтов КЦ. Для этого необходимо включить настройку **«Использовать настроенные дисконты»** и настроить требуемые дисконты для инструментов на вкладке **«Дисконты»** или **«Дисконты по бумагам»**. При этом если значение «Д long» не указано, то принимаем «D long» =1. Если не указано значение «Д short», то принимаем «D short»=**+∞**.

   Возможно настроить дисконты для определенного клиента по префиксу клиентского кода на странице «Клиенты/Настройки “плеча”» и для группы клиентов на странице «Клиенты/Шаблоны/По “плечу”». В таком случае настройки будут иметь следующий приоритет (в порядке убывания):

   - По коду клиента;
   - По шаблону;
   - По префиксу;
   - Глобальная.

2. Второй способ.

   Если для рассматриваемого клиента и вида лимита опция «Использовать настроенные дисконты» отключена, то используется следующий порядок настройки и алгоритм расчета эффективных дисконтов:

   В качестве исходных данных для расчета используются следующие параметры:

   - «Д long» – минимальное значение дисконта брокера для длинной позиции;
   - «Д short» – минимальное значение дисконта брокера для короткой позиции;
   - «К long» – коэффициент ставки риска длинной позиции;
   - «К short» – коэффициент ставки риска короткой позиции;
   - «КЦ» – дисконт Клирингового центра (далее – КЦ), выраженный в процентах. Дисконты КЦ транслируются через Программный интерфейс Клиринговой системы

Фондового рынка Московской Биржи в рамках класса «РЕПО с ЦК информационный» и доступны в Рабочем месте QUIK в Таблице текущих торгов. Если для инструмента не транслируются дисконты КЦ, то значения КЦ принимаются равными 100%. Торговая система транслирует ставки риска (дисконты) для трех диапазонов («1», «2» и «3»), а также индикативные ставки риска нулевого лимита концентрации (по умолчанию транслируется Торговым интерфейсом Фондового рынка Московской Биржи (сектор «Основной рынок») в диапазоне «10»). Для управления диапазоном ставок риска в БРЛ предусмотрены настройки «Уровень ставки рыночного риска» и «Уровень ставки рыночного риска по классам». По умолчанию в настройке «Уровень ставки рыночного риска» используются дисконты из третьего диапазона.

Аналогичным образом настройка выполняется индивидуально, по шаблону и по префиксу (на вкладках «Клиенты/Настройки "плеча"» и «Клиенты/Шаблоны/По "плечу"»)

> **Если КЦ транслирует дисконт, равный 100% и более, то «КЦ» для расчетов «D short» принимаем равным 100%.**

Настройка параметров «Д long», «Д short», «К long» и «К short» осуществляется на вкладке **«Дисконты»** в разделе «Настройки маржинального кредитования». Аналогичным образом настройка выполняется индивидуально, по шаблону и по префиксу.

Алгоритм определения значения эффективных дисконтов «D long» и/или «D short»:

Дисконт КЦ	**Настройки в разделе «Дисконты»**		**Формулы расчета эффективных дисконтов**	
	Д long/short	К long/short	D long	D short
Не транслируется	-	-	1	+∞
	-	Задан	1	+∞
	Задан	-	$Д_{long}$	$Д_{short}$
	Задан	Задан	1	+∞
Транслируется	-	-	1	+∞
	-	Задан	$1-(1-КЦ)^{K_{long}}$	$(1+КЦ)^{K_{short}}-1$
	Задан	-	$Д_{long}$	$Д_{short}$
	Задан	Задан	$1-(1-Max(КЦ;\ Д_{long}))^{K_{long}}$	$(1+Max(КЦ;\ Д_{short}))^{K_{short}}-1$

Настройка минимальных дисконтов

В схеме «по дисконтам» клиент может задавать собственные значения минимальных дисконтов по инструменту двумя способами:

1. Первый способ.

   Вводятся коэффициенты, позволяющие клиенту корректировать значения эффективных минимальных дисконтов по своему усмотрению:

   - «Long» – корректирующий коэффициент для длинной позиции. Допустимая область значений: [0;1];
   - «Short» – корректирующий коэффициент для короткой позиции. Допустимая область значений: [0;1].

   В результате, формулы вычисления эффективных дисконтов для определения уровня минимальной маржи принимают следующий вид:

$$D_{long}^{MIN} = 1 - (1 - D_{long})^{\frac{1+\text{Long}}{2}}$$

$$D_{short}^{MIN} = (1 + D_{short})^{\frac{1+\text{Short}}{2}} - 1$$

   Параметры могут быть заданы глобально, а также для отдельных групп клиентов. Если параметры не заданы, то по умолчанию определяются как «0».

2. Второй способ.

   Явное указание собственных минимальных дисконтов по инструментам аналогично заданию начальных дисконтов. Для каждого инструмента могут быть определены минимальные дисконты для оценки длинной и короткой позиций:

   - «Д min long» – минимальный дисконт для длинной позиции. Допустимая область значений: [0;1];
   - «Д min short» – минимальный дисконт для короткой позиции. Допустимая область значений: [0;+∞].

   В соответствии с Приказом, формулы для вычисления эффективных минимальных дисконтов для длинных и коротких позиций соответственно имеют следующий вид:

$$D_{Long}^{MIN} = MIN\left(D_{Long}; MAX\left(1 - \sqrt{1 - D_{Long}}; \text{Д min } long\right)\right)$$

$$D_{Short}^{MIN} = MIN(D_{Short}; MAX(\sqrt{1 + D_{Short}} - 1; \text{Д min } short))$$

3. Совместимость способов указания минимальных дисконтов

   В случае одновременного использования брокером обоих вариантов, описанных в пунктах 1 и 2, определение эффективных минимальных дисконтов осуществляется по следующим правилам:

$$D_{Long}^{MIN} = MIN(D_{Long}; MAX(1 - (1 - D_{long})^{\frac{1+\text{Long}}{2}}; \text{Д min } long))$$

$$D_{Short}^{MIN} = MIN(D_{Short}; MAX((1 + D_{short})^{\frac{1+\text{Short}}{2}} - 1; Д\min short))$$

Таким образом, варианты задания минимальных дисконтов не являются взаимоисключающими, в случае необходимости они могут использоваться одновременно.

Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ

Настройка «Использовать дисконты КЦ» должна работать в связке с настройкой «Использовать настроенные дисконты». В зависимости от комбинации настроек, а также наличия транслируемых дисконтов КЦ и собственных дисконтов, эффективные дисконты определяются в следующем порядке:

1. **Обе настройки выключены:**

1.1. КЦ транслирует дисконт <100% и заданы собственные дисконты:

- если ставка риска K_long/short задана в настройках, эффективные дисконты выбираются по формуле с учётом максимума из дисконтов и показателя степени в виде ставки риска;
- если ставка риска не задана – используются собственные дисконты;

1.2. КЦ транслирует дисконт <100%, но не заданы собственные дисконты – инструмент немаржинален;

1.3. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, но заданы собственные дисконты:

- если ставка риска K_long/short задана в настройках:
  - для короткой позиции – инструмент немаржинален;
  - для длинной позиции – используются дисконты КЦ.
- если ставка риска не задана, используются собственные дисконты;

1.4. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, и не заданы собственные дисконты:

- для короткой позиции – инструмент немаржинален;
- для длинной позиции – используются дисконты КЦ.

2. **Включена настройка «Использовать настроенные дисконты» и выключена настройка «Использовать дисконты КЦ»:**

2.1. КЦ транслирует дисконт <100% и заданы собственные дисконты – используются собственные дисконты;

2.2. КЦ транслирует дисконт <100%, но не заданы собственные дисконты – инструмент немаржинален;

2.3. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, но заданы собственные дисконты – используются собственные дисконты;

2.4. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, и не заданы собственные дисконты:

- для короткой позиции – инструмент немаржинален;

- для длинной позиции – используются дисконты КЦ.

3. Выключена настройка «Использовать настроенные дисконты» и включена «Использовать дисконты КЦ»:

3.1. КЦ транслирует дисконт <100% и заданы собственные дисконты – используются дисконты КЦ;

3.2. КЦ транслирует дисконт <100%, но не заданы собственные дисконты – используются дисконты КЦ;

3.3. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, но заданы собственные дисконты:

- если ставка риска K_long/short задана в настройках:
  - для короткой позиции – инструмент немаржинален;
  - для длинной позиции – используются дисконты КЦ.
- если ставка риска не задана, используются собственные дисконты;

3.4. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, и не заданы собственные дисконты:

- для короткой позиции – инструмент немаржинален;
- для длинной позиции – используются дисконты КЦ.

4. Обе настройки включены:

4.1. КЦ транслирует дисконт <100% и заданы собственные дисконты:

- если ставка риска задана в настройках, эффективные дисконты выбираются по формуле (см. п. 1.1.);
- если ставка риска не задана, используются дисконты КЦ;

4.2. КЦ транслирует дисконт <100%, но не заданы собственные дисконты – используются дисконты КЦ;

4.3. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, но заданы собственные дисконты – используются собственные дисконты;

4.4. КЦ не транслирует дисконт или транслируемый дисконт >=100%, и не заданы собственные дисконты:

- для короткой позиции – инструмент немаржинален;
- для длинной позиции – используются дисконты КЦ.

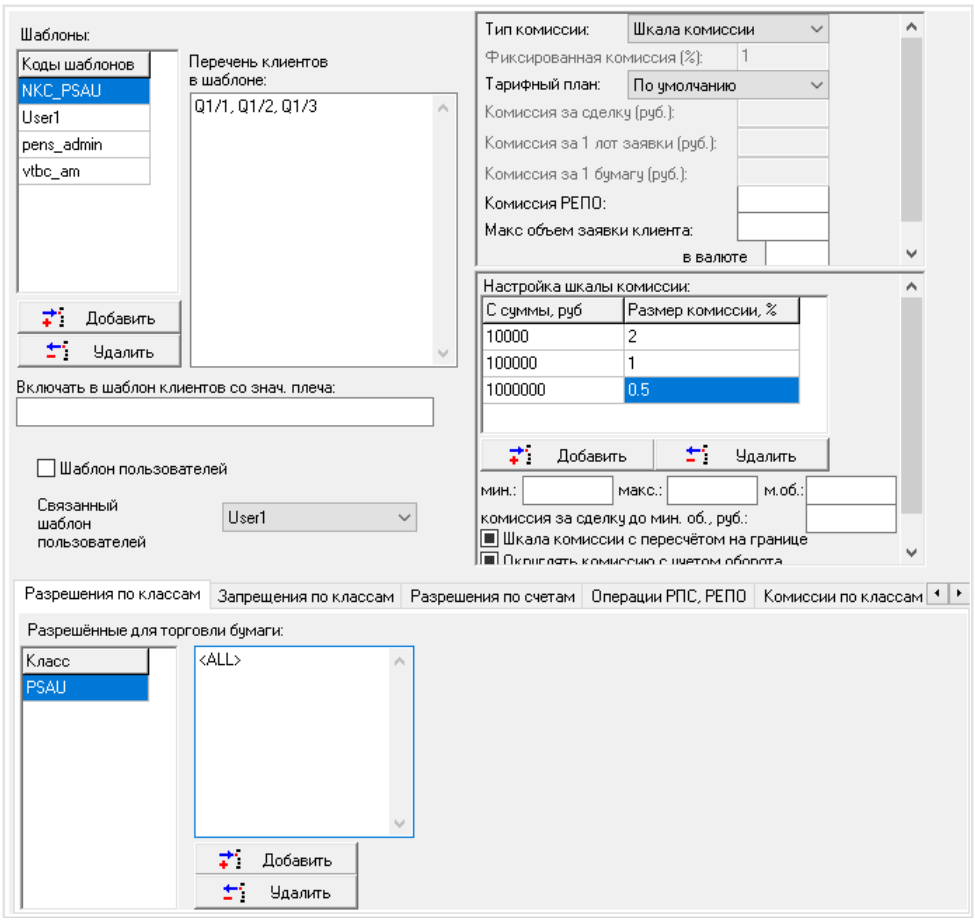
Настройки «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» имеют следующий приоритет:

1. Индивидуальная настройка «Привязка инструментов к видам лимитов» (см. п. 13, п. 15).
2. Глобальная настройка «Привязка инструментов к видам лимитов» (см. п. 8.2).

3. Индивидуальная настройка «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» (см. п. 13, п. 15).
4. Глобальная настройка «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» (см. п. 7).
5. Индивидуальная настройка «Привязка классов к видам лимитов» (см. п. 13, п. 15).
6. Глобальная настройка «Привязка классов к видам лимитов» (см. п. 4.5).

14.Клиенты / Шаблоны / По комиссии

Данная страница предназначена для формирования шаблонов брокерской комиссии, просмотра и редактирования списка клиентов, к кодам которых применяется выбранный шаблон.



Параметр	Назначение
Шаблоны	Список сохраненных шаблонов

Параметр	Назначение
Перечень клиентов в шаблоне / Перечень пользователей в шаблоне	Список идентификаторов клиентов, разделенных запятыми, к которым применяется данный шаблон. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1). При установленном флажке «Шаблон пользователей» название параметра меняется на «Перечень пользователей в шаблоне» и содержит список идентификаторов пользователей. Один и тот же идентификатор пользователя может быть указан в нескольких пользовательских шаблонах
Включать в шаблон клиентов со знач. плеча	Список значений плеча через запятую, в соответствии с которым клиенты включаются в шаблон. Значение указывается с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Настройки шаблона применяются для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Не допускается указание одного и того же значения плеча в нескольких шаблонах по комиссии. Плечо задается на денежном лимите клиента в Рабочем месте QUIK. Рекомендуется использовать одинаковые значения плеча на всех лимитах. Подробнее см. в Комментарии 1 к данной настройке. Приоритет выбора шаблона «По комиссии» см. в Комментарии 2. По умолчанию настройка не задана
Шаблон пользователей	Определить шаблон, выбранный в списке «Шаблоны», как пользовательский, а настройки комиссии в нем использовать для начисления комиссии за сделки с голоса. Комиссия применяется к операциям пользователей, перечисленных в поле «Перечень пользователей в шаблоне». Для начисления комиссии с голоса нужно привязать клиентский шаблон к пользовательскому шаблону, выбрав его в списке «Связанный шаблон пользователей». В шаблонах с признаком «Шаблон пользователей» учитываются следующие настройки: _ «Перечень пользователей в шаблоне»; _ «Тип комиссии»; _ «Фиксированная комиссия (%)»; _ «Комиссия за сделку (руб.)»; _ «Комиссия за 1 лот заявки (руб.)»; _ «Комиссия за 1 бумагу (руб.)»; _ «Комиссия РЕПО»; _ «Настройка шкалы комиссии»; _ «Комиссия по классам и инструментам»; _ «Валюта списания комиссии»; _ «Комиссия от объема операции»; _ «Комиссия по базовому активу;

Параметр	Назначение
	_ «Запрет операции при нехватке средств под комиссию»; _ «Разрешить закрытие позиции при нехватке средств под комиссию»; _ «Тарифный план». Настройки комиссии с голоса в шаблоне пользователя имеют более высокий приоритет, чем базовые настройки комиссии за сделки с голоса на странице «Общие параметры» вкладка «Брокер» (см. п. 4.6), а также настройка комиссии с голоса на странице «Пользователи» (см. п. 9)
Связанный шаблон пользователей	Выбор шаблона пользователей, связанного с шаблоном клиентов. Поле доступно, если флажок «Шаблон пользователей» снят
Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Описание типов комиссии см. в п. 10 «Клиенты» / «Комиссия брокера»
Фиксированная комиссия (%)	Величина фиксированной комиссии, в %. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Фиксированная комиссия» или «Max(сдел., фикс.)»
Тарифный план	Выбор тарифного плана для шкалы комиссии. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». Тарифные планы формируются на странице «Брокерская комиссия». Если другие тарифные планы не заданы, используется тарифный план «По умолчанию»
Комиссия за сделку (руб)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждое исполненное поручение. Параметр «Типа комиссии» должен иметь значение «За сделку», «Max(сдел., фикс.)» или «Max(сдел., штуку)»
Комиссия за 1 бумагу (руб.)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждую единицу инструмента в заявке. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «За бумагу» или «Max(сдел., штуку)»
Комиссия за 1 лот заявки (руб.)	Величина брокерской комиссии, взимаемой за каждый лот в заявке. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «За лот»
Комиссия РЕПО	Величина комиссии по сделкам РЕПО в % за каждый день срока РЕПО. Значение поля не может быть нулевым, нулевое значение будет сброшено при сохранении результатов редактирования. Если значение не указано, то комиссия рассчитывается по глобальным установкам, см. п. 4.6. Параметр имеет меньший приоритет по отношению к настройке комиссии по классам, задаваемой на вкладке «Комиссии по классам». Для классов РЕПО настройка имеет более высокий приоритет, чем другие настройки комиссии, заданные в шаблоне. Если флажок «Приоритет комиссии в шаблоне для операций РЕПО» (см. п. 4.8) включен, то в рамках настроек комиссии, заданных на шаблон,

Параметр	Назначение
	комиссия РЕПО менее приоритетна, чем настройки комиссии, заданные на конкретный класс. При этом следует учитывать, что: _ комиссия может быть задана на класс через выбранный тарифный план; _ «нулевая комиссия» в тарифном плане (см. п. 6.1.1) не считается настройкой, заданной на класс, и имеет меньший приоритет, чем комиссия РЕПО
Макс.объем заявки клиента	Максимальный размер одной заявки клиента вне зависимости от класса инструментов, выраженный в валюте расчетов
_ в валюте	Валюта, в которой указывается максимальный размер заявки клиента
Игнорировать комиссии за сделки с голоса	Отключает снятие комиссии за сделки с голоса по данному клиенту
Настройка шкалы комиссии	Настройка шкалы комиссии. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». О правилах настройки шкалы комиссии см. п. 4.7. Валюта, в которой интерпретируются значения суммы, комиссии и оборота в данной настройке, может быть изменена для заданного списка классов (подробнее см. п. 6.2.1)
_ С суммы, руб.	Нижняя граница дневного оборота клиента, с которой начинается применение данной ставки комиссии
_ Размер комиссии,%	Величина комиссионного вознаграждения в процентах
Мин.	Минимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
Макс.	Максимальное значение брокерской комиссии за день, в валюте расчетов
М. об.	Минимальный дневной оборот, с которого начисляется комиссия, в валюте расчетов
Комиссия за сделку до мин. об.	Фиксированная комиссия за каждую сделку, в валюте расчетов. Комиссия взимается до тех пор, пока дневной оборот не превысит значения «М. об.». По умолчанию поле пустое
Округлять комиссию с учетом оборота	Включает корректный расчет комиссии в случаях сделок малого объема и при частичном исполнении заявки несколькими сделками меньшего объема. Флажок имеет три состояния: «включен» – комиссия брокера по шкале округляется на суммарный торговый объем клиентских операций за день, «выключен» – не применяется, флажок на

Параметр	Назначение
	сером фоне – используется глобальная настройка. Подробнее см. п. 4.1
Шкала комиссии с пересчетом на границе	Включает перерасчет значения комиссии при переходе границы между различными процентными ставками. Параметр «Тип комиссии» должен иметь значение «Шкала комиссии». Флажок имеет три состояния: «включен» – пересчет на границе применяется, «выключен» – не применяется, закрашенный квадрат – используется глобальная настройка. Подробнее о пересчете см. п. 4.1
Вкладка «Разрешения по классам», см. Комментарий	
Разрешенные для торговли бумаги	Настройка списка бумаг, разрешенных клиенту для совершения торговых операций. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, разрешенных для торговли
_ Класс	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка
_ Список инструментов	Список идентификаторов разрешенных бумаг, через запятую. Для обозначения всех бумаг класса укажите <All>. Так же возможно использовать префикс для инструментов, например, можно разрешить все бумаги, начинающиеся на A*
Вкладка «Запрещения по классам», см. Комментарий	
Запрещенные для торговли бумаги	Настройка списка бумаг, запрещенных клиенту для совершения торговых операций. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, запрещенных для торговли. Правила настройки те же, что и для вкладки «Разрешения по классам»
*Запрещения на открытие позиций	Настройка списка инструментов, запрещенных клиенту для открытия новых позиций, а также для наращения (по модулю) ранее открытых позиций. Для пользователей с включенной настройкой «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу настройка игнорируется. Для обозначения всех инструментов класса укажите в качестве кода инструмента <All>. Также возможно использовать префикс кода инструмента. Например, можно запретить все инструменты, начинающиеся на RI*. Действие настройки «Запрещения на открытие позиций» распространяется только на инструменты, торговля которыми не запрещена другими настройками
Вкладка «Разрешения по счетам»	

Параметр	Назначение
Разрешенные для торговли бумаги (по счетам)	Настройка списка бумаг, разрешенных клиенту для совершения торговых операций по указанному счету. Если какой-либо счет включен в список «Счет», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, разрешенных для торговли
_ Торговый счет	Код торгового счета, в отношении которого действует ограничение. Новый счет добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом обозначения счета в открывшемся окне
_ Список инструментов	Список идентификаторов разрешенных бумаг, через запятую
Вкладка «Операции РПС, РЕПО», приоритет использования настроек см. в Комментарии 6	
Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета	
Разрешённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, разрешенных для операций РПС, РЕПО
_ Все коды расчётов	Разрешены все коды расчетов (нет ограничений)
_ По списку	Разрешены коды расчетов, перечисленные в списке через запятую. Использование префикса кода расчетов не допускается
Запрещённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, запрещенных для операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных кодов
Ограничение операций РПС, РЕПО по коду контрагента	
Разрешённые контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты (нет ограничений)
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую. Указание префикса контрагента не допускается
Запрещённые контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных контрагентов
Вкладка «Комиссии по классам»	
Комиссия по классам и инструментам	Настройка типов комиссии для отдельных классов и групп инструментов. Настройки комиссии для классов РЕПО на данной вкладке имеют более высокий приоритет по сравнению с настройкой «Комиссия РЕПО». Приоритет выбора ставки комиссии см. в п. 6.3.2
_ Класс/Группа	Код класса или группы, для инструментов которых назначена комиссия. Чтобы добавить класс / группу, нажмите на кнопку «Добавить», в открывшемся окне выберите тип создаваемого

Параметр	Назначение
	элемента (класс / группа), выберите код класса / группы и нажмите кнопку «ОК». Комиссия на класс / группу имеет более высокий приоритет по сравнению с другими настройками расчёта комиссии брокера по шаблону
_ Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Описание типов комиссии см. в п. 10 «Клиенты» / «Комиссия брокера»
_ Величина	Величина брокерской комиссии. Для комиссий типа «Max» – величина брокерской комиссии за сделку. Единицы измерения зависят от выбранного типа комиссии
_ Величина 2	Для типа комиссии «Max(сдел., фикс.)» – фиксированная величина брокерской комиссии в процентах; Для типа комиссии «Max(сдел., штуку)» – величина брокерской комиссии за единицу инструмента в валюте расчетов
Валюта списания комиссии	Настройка списка кодов валют, в которых производятся проверка и блокировка по заявке, а также разблокировка и списание по сделке. Используется для схем кредитования клиентов «по дисконтам», «МД+» и «по плечу». Если при использовании настройки «Вести денежные позиции в разрезе валют» настройка «Валюта списания комиссии» включена, то настройка «Валюта расчета комиссии» (см. п. 6.1.4) также должна быть включена. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройки «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции (при отсутствии лимитов) и «Игнорировать проверку для адресных заявок»
Не пров. при отл. вал. расчетов	Не проверять достаточность средств под комиссию, если валюта списания комиссии отличается от валюты расчетов
Запр. опер. при нехв. сред. под ком.	Запрет операций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке запрещены все операции (в том числе закрытие позиций) по классам, перечисленным в списке, если объём комиссии превышает доступный остаток в указанной валюте списания комиссии. При закрытии позиций достаточность объёма под комиссию проверяется только на плановом виде лимита по указанной валюте. По умолчанию настройка выключена
Разр. зак. поз. при нехв. ср. под ком.	Разрешить закрытие позиций при нехватке средств под комиссию. При включенной настройке разрешены операции закрытия позиций при нехватке средств под комиссию. Настройка имеет смысл при включенной настройке «Запр. опер. при нехв. сред. под ком.».

Параметр	Назначение
	По умолчанию настройка выключена
_ Валюта	Код валюты, в которой сервер QUIK списывает комиссию. О недопустимых значениях см. в Комментарии 3
_ Тип комиссии	Тип комиссии. Возможные значения: _ «Суммарная» – комиссия брокера и торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового (акции, облигации) и валютного рынков; _ «ТС» – комиссия торговой системы. Для данного типа комиссии могут быть указаны классы фондового рынка (акции, облигации). О недопустимых значениях см. в Комментарии 3
_ Список классов	Список классов через запятую, для которых указан код валюты комиссии. О недопустимых значениях см. в Комментарии 3
Классы без учета комиссии ТС	
_ Классы	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка. Класс удаляется нажатием кнопки «Удалить» и выбором наименования из списка. Настройка имеет более высокий приоритет, чем настройка «Использовать комиссию ТС». По умолчанию настройка не задана
Вкладка «Комиссия от объема операции». Об особенностях задания настроек см. в Комментарии 8	
Классы/Группы	Список классов/групп через запятую, для которых действуют ставки комиссии. Настройка применяется для операций на фондовом рынке (акции, облигации), в том числе для операций РЕПО (денежный рынок). Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с глобальной настройкой «Комиссия от объема операции» на странице «Брокерская комиссия», вкладка «Ставки» (см. п. 6.3.1). Настройка имеет самый высокий приоритет среди всех настроек комиссии брокера, заданных на код клиента в шаблоне
Объем	Нижняя граница объема поручения, к которой применяется данная ставка комиссии, в валюте параметров комиссии (см. п. 6.2.1). Если настройка «Валюта параметров комиссии» для класса не задана, то значение объема интерпретируется в рублях. Для операций РЕПО комиссия рассчитывается исходя из объема первой части операции

Параметр	Назначение
Направление	Направление операции. Для операций РЕПО задается направление первой части. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа»; _ «Не задано» – комиссия применяется к операциям любого направления
Тип комиссии	Выбор способа указания комиссии. Возможные значения: _ «% от объема» – процент от объема поручения; _ «Max (%; за поручение)» – используется большее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение; _ «Min (%; за поручение)» – используется меньшее значение из суммы комиссии, вычисленной как процент от объема, и суммы за поручение
% от объема	Сумма комиссии вычисляется как процент от объема поручения
За поручение	Максимальная или минимальная (в зависимости от типа комиссии) сумма комиссии брокера по всем сделкам в рамках одного поручения
Вкладка «Вывод средств»	
Классы вывода средств	Список классов, операции по которым не приводят к увеличению текущих остатков средств клиента по деньгам (при продаже) и по бумагам (при покупке). Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Классы»
Режимы вывода денежных средств	Список классов, операции по которым не приводят к увеличению текущих остатков средств клиента по деньгам (при продаже), но при покупке зачисление бумаг на счет производится. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Классы»
Вкладка «Специальные классы»	
Классы без расчёта и контроля лимитов	Список классов инструментов, по которым не выполняются проверки достаточности средств для исполнения заявок клиентов. Для указанных классов настройки «Ограничения по классам инструментов» и «Ограничения по инструментам», заданные на странице «Ограничения на … / Цены заявок» (см. п. 20), игнорируются. Список, указанный в данной настройке, дополняет глобальный список на странице «Классы»
Классы с проверкой регистрационного номера бумаги (CFI кода)	Список классов бумаг, по которым осуществляется проверка допустимости CFI кода. Настройка имеет более высокий приоритет

Параметр	Назначение
	по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Классы». Настройка не учитывается для операций закрытия позиций
Классы без блокировки средств под заявки	Список классов бумаг, при торговле которыми будут применены особые правила: _ при подаче заявки осуществляется только проверка соответствия параметров заявки ограничениям (на цену, объем и т.д.), проверка покупательной способности клиента не производится; _ не блокируются средства под заявку; _ при регистрации сделки производится безусловное начисление/списание средств. Список, указанный в данной настройке, дополняет глобальный список на странице «Классы»
Классы с контролем минимального количества в заявках	Контроль минимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Классы». При проверке игнорируется опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3)
_ Список классов	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиент
_ Количество	Минимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, меньше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то используется значение параметра «Минимальное кол-во» из Таблицы текущих торгов инструмента заявки. Если значение в Таблице текущих торгов не удалось найти, заявка отвергается с диагностикой «Неверно указано количество»
Классы с контролем минимального объема в заявках	Контроль минимально допустимого объема заявки по заданному классу инструментов. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Классы
_ Класс	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимый объем заявки
_ Объём	Минимальный объем одной заявки клиента, выраженный в валюте расчетов. Заявки с объемом, меньше заданного, отвергаются при проверке покупательной способности
_ Валюта	Валюта, в которой задается ограничение минимального объема в заявках. Значение допустимого объема заявки рассчитывается в заданной валюте, и, если валюта расчетов отличается от заданной, ограничение пересчитывается согласно кросс-курсу.

Параметр	Назначение
	Если валюта не задана, то значение ограничения рассчитывается в валюте расчетов без конвертации
Позиции в разрезе валют	Список классов, в которых торгуются валютные пары. По инструментам из этих классов не устанавливаются и не ведутся лимиты по бумагам. При регистрации сделок с валютными парами в QUIK меняются только денежные позиции по соответствующим валютам. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с глобальной настройкой «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы». При использовании схемы кредитования клиентов «по дисконтам» или «МД+» для корректной работы функционала ведения денежных позиций в разрезе валют также необходимо указать значения дисконтов на используемые валюты в настройках вида «Список дисконтов по бумагам». Используемые валюты должны быть объединены в рамках настройки «Доп. теги расчетов» / «Дополнительные валюты»
Классы, в которых запрещено выставление стоп-заявок	Список классов инструментов, по которым запрещено выставление стоп-заявок. Настройка проверяется также для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции
Вкладка «Ограничение цен заявок» Шаблон индивидуальных настроек ограничений цен заявок, использующих либо не использующих кредитные ресурсы. Настройки могут быть заданы индивидуально на клиента (см. п. 10), по префиксу клиентского кода либо в виде шаблона. Набор параметров и их назначение аналогичны глобальным настройкам, описанным в п. 20	
Вкладка «Д.О.: Ограничение цен заявок» Настройка дополнительных ограничений цен заявок. Набор параметров и их назначение аналогичны глобальным настройкам, описанным в п. 20. Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Мультивал. ден. позиция» Шаблон индивидуальных настроек мультивалютной денежной позиции. Настройки в шаблоне имеют более высокий приоритет относительно глобальных настроек. Набор параметров и их назначение аналогичны глобальным настройкам, описанным в п. 19. Описание таблицы «Дополнительные валюты» приведено в п. 17.	
Вкладка «Комиссия по баз. активу»	

Параметр	Назначение
Шаблон индивидуальных настроек величины комиссии по сделкам с фьючерсами на ФОРТС для перечисленных клиентов. Задаётся для каждого базового актива отдельно, в валюте расчетов за лот. Назначение настройки аналогично глобальной настройке, описанной в п. 4.8 (раздел «Общие параметры» / «Настройки комиссионного вознаграждения по режимам торгов» / «По базовому активу»)	
Вкладка «Запр. РПС, РЕПО по классам», приоритет, особенности и примеры использования настроек см. в Комментарии 5	
Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Запрещены все контрагенты
_ По списку	Запрещены контрагенты, перечисленные в списке через запятую
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки больше указанного, операция запрещена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»

Параметр	Назначение
Вкладка «Разр. РПС, РЕПО по классам», приоритет, особенности и примеры использования настроек см. в Комментарии 5	
Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки меньше или равен указанному, операция разрешена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»
Вкладка «Д.О.: Запреты РПС, РЕПО по классам» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций РПС и РЕПО. Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	

Параметр	Назначение
Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО. Набор параметров и их назначение аналогичны одноимённой настройке на вкладке «Запр. РПС, РЕПО по классам», см. выше
Вкладка «Комиссия РЕПО» — задание ставок для разных классов	
Комиссия РЕПО по классам за день срока	Ставки комиссии РЕПО за день срока в разрезе классов
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Настройка на конкретный класс приоритетнее, чем настройка на <ALL>
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения: _ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в % от суммы РЕПО за каждый день срока; _ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Обязательно для заполнения для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно. Значение по умолчанию «0» – не задано
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
Вкладка «Шкала комиссии РЕПО» – настройка ставки комиссии РЕПО	
Шкала комиссии РЕПО по классам	Шкала ставок комиссии РЕПО в разрезе классов. Настройка имеет более высокий приоритет, чем настройка «Комиссия РЕПО по классам за день срока»
_ Классы	Список кодов классов через запятую. Поддерживается значение <ALL>, соответствующее всем классам. Обязательно для заполнения при добавлении строки. Дублирование кода класса не допускается

Параметр	Назначение
_ Срок РЕПО	Срок сделки РЕПО. Ставка применяется к сделкам, срок РЕПО которых больше или равен заданному количеству дней при отсутствии подходящей ставки с большим количеством дней. Срок РЕПО задается обязательно начиная с 0
_ Тип ставки	Тип ставки комиссии РЕПО. Возможные значения: _ «% от суммы РЕПО» (по умолчанию) — ставка в % от суммы РЕПО за каждый день срока; _ «за сделку» — фиксированная сумма за сделку за весь срок (валюта суммы определяется настройкой «Валюта параметров комиссии»); _ «макс(%;за сделку)» — максимальное значение между процентом от суммы РЕПО (% от суммы РЕПО) и фиксированной суммой за сделку (за сделку); _ «сумма(%;за сделку)» — суммарное значение, складывающееся из процента от суммы РЕПО и фиксированной суммы за сделку
_ % от суммы РЕПО	Ставка 1. Доступно для редактирования для типов ставки комиссии «% от суммы РЕПО», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно
_ за сделку	Ставка 2. Доступно для редактирования для типов ставки «за сделку», «макс(%;за сделку)», «сумма(%;за сделку)», для остальных типов недоступно

* – о применении см. комментарий к п. 10.

Комментарий 1 к настройке «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча»

Чтобы включить клиента в шаблоны по комиссии, по ограничениям и по плечу, в настройке «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» необходимо указать идентификаторы: значения из столбцов в соответствующих шаблонах по комиссии и по ограничениям, а значения строк – в соответствующих шаблонах по плечу. Идентификатор плеча для каждого сочетания присваивается брокером.

Пример:

У брокера настроены 2 шаблона по комиссии, 2 шаблона по ограничениям и 2 шаблона по плечу, а также присвоены следующие сочетания шаблонов в виде идентификаторов: первые две цифры идентификатора определяют шаблон по комиссии, вторые две цифры – шаблон по ограничениям, третьи две цифры – шаблон по плечу:

Шаблон по комиссии_11	Шаблон по комиссии_12

	Шаблон по огр._11	Шаблон по огр._12	Шаблон по огр._11	Шаблон по огр._12
Шаблон по плечу_11	111111	111211	121111	121211
Шаблон по плечу_12	111112	111212	121112	121212

В настройке «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» необходимо указать значения из столбцов в соответствующих шаблонах по комиссии, а значения из строк – в соответствующих шаблонах по плечу.

Если в «Шаблоне по плечу_12» в поле «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» указаны значения «111112, 111212», то при изменении размера плеча клиента, например, с 111112 на 121112, для него изменяются настройки шаблона по комиссии (клиент перемещается из «Шаблона по комиссии_11» в «Шаблон по комиссии_12»), но остаются прежними настройки шаблона по ограничениям («Шаблон по огр._11») и по плечу («Шаблон по плечу_12»).

Комментарий 2

Приоритет выбора шаблона «По комиссии»:

1. Настройки по шаблону, в котором значение поля «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» совпадает со значением последнего заданного «плеча» на денежном лимите клиента (см. на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По комиссии», п. 14). Учитывается только для клиентов с типом кредитования «По дисконтам» или «МД+».
2. Индивидуальные настройки, заданные на вкладке «Клиенты / Комиссия брокера» (см. п. 10).
3. Настройки по шаблону для нескольких кодов клиентов, заданному на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По комиссии» (см. п. 14).
4. Настройки для группы клиентов, заданные на вкладке «Клиенты / Комиссия брокера» по префиксу кода клиента (см. п. 10).

Если ни одна из вышеперечисленных настроек для клиента не задана, то используются глобальные настройки.

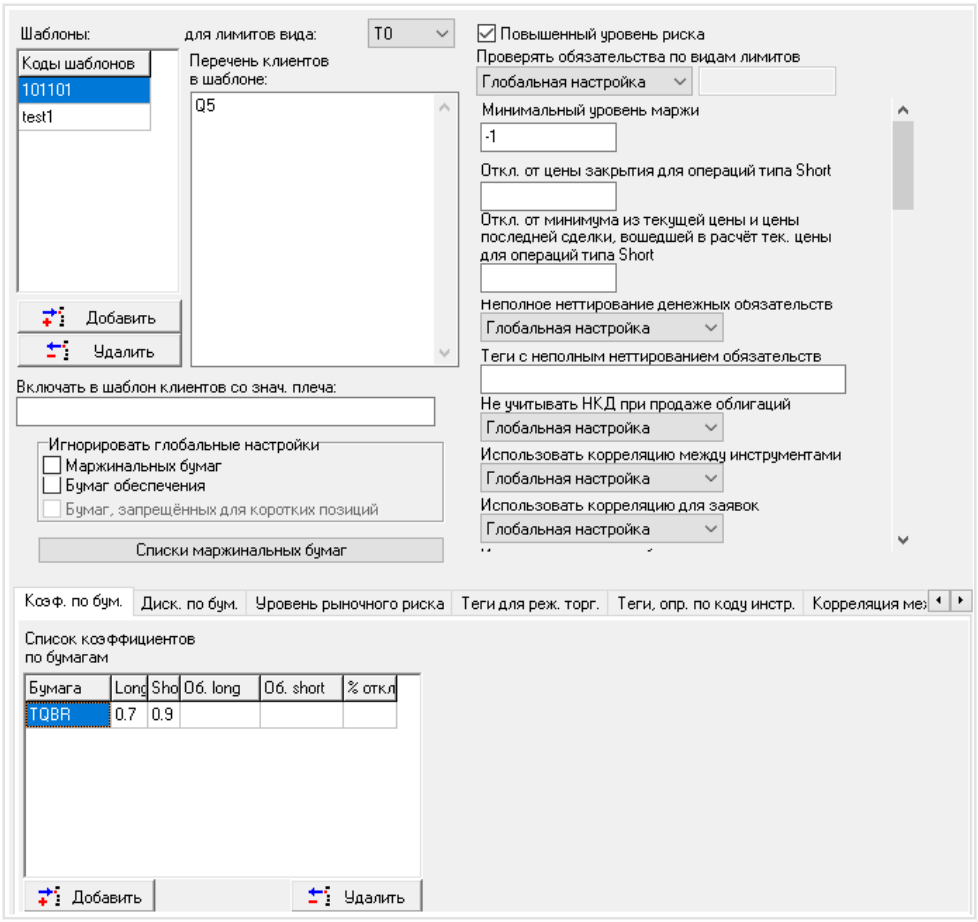
Комментарий 3

Не допускается указание одного класса для разных валют и одного типа комиссии, а также дублирование сочетания кода валюты и типа комиссии в разных строках таблицы. Если класс указан одновременно для типов комиссии «ТС» и «Суммарная»,

то для комиссии брокера используется код валюты, указанный для типа комиссии «Суммарная».

15.Клиенты / Шаблоны / По «плечу»

Страница предназначена для настройки шаблонов использования кредитного «плеча» при маржинальной торговле, просмотра и редактирования списка клиентов, к которым применяется выбранный шаблон.



Параметр	Назначение
Шаблоны	Список сохраненных шаблонов
для лимитов вида:	Все настройки раздела распространяются на операции, «привязанные» к указанному виду лимита. Такая привязка осуществляется по режиму торгов операции (определяется настройкой «Привязка классов к видам лимитов»), по инструменту (определяется настройкой «Привязка инструментов к видам лимитов») или по режиму торгов и коду расчетов (определяется настройкой «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов»).

Параметр	Назначение
	Для всех значений данной настройки значения параметров «Проверять обязательства по видам лимитов» и «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов» должны быть одинаковыми
Перечень клиентов в шаблоне	Список кодов клиентов, разделенных запятыми, к которым применяется данный шаблон. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1)
Включать в шаблон клиентов со знач. плеча	Список значений плеча через запятую, в соответствии с которым клиенты включаются в шаблон. Значение указывается с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Настройки шаблона применяются для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Не допускается указание одного и того же значения плеча в нескольких шаблонах по плечу. Плечо задается на денежном лимите клиента в Рабочем месте QUIK. Рекомендуется использовать одинаковые значения плеча на всех лимитах. Подробнее см. в Комментарии 1 к аналогичной настройке в п. 14. Приоритет выбора шаблона «По "плечу"» см. в Комментарии. По умолчанию настройка не задана
Игнорировать глобальные настройки	Отключает использование для данного клиента списков бумаг, заданных «по умолчанию» для всех клиентов. Эти списки задаются на странице «Ограничения на / Использование плеча». Настройки из данного блока предназначены для игнорирования ограничений на тип маржинальности бумаг (маржинальные бумаги, бумаги обеспечения и бумаги, запрещенные на открытие коротких позиций), установленных для других клиентов. Включение каждой опции клиенту означает, что все доступные ему бумаги будут иметь этот тип маржинальности. Настроить индивидуальный список бумаг при включенной опции для клиента невозможно
_ Маржинальных бумаг	Игнорировать список бумаг, разрешенных для маржинальной торговли всем клиентам
_ Бумаг обеспечения	Игнорировать список бумаг, принимаемых в обеспечение маржинальных сделок всех клиентов
_ Бумаг, запрещенных для коротких позиций	Игнорировать список бумаг, запрещенных для операций «short» всем клиентам
Списки маржинальных бумаг	Открытие формы для настройки списка маржинальных бумаг (описание приведено в п. 32).

Параметр	Назначение
	Настройка «Маржинальные бумаги в заданном классе» имеет более высокий приоритет, чем настройка «Классы, в которых заданная бумага маржинальна». Подробнее см. в комментарии к п. 32
Повышенный уровень риска	Все клиенты в шаблоне идентифицируются как клиенты с повышенным уровнем риска (КПУР). Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «МД+»
Проверять обязательства по видам лимитов	Настройка проверки обязательств по видам лимитов
_ Да	Проверка обязательств для указанных сроков расчетов
_ Нет	Проверка обязательств только по лимиту операции
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Общие настройки библиотеки. Часть 5»
Минимальный уровень маржи	Минимальный уровень маржи, контролируемый для данного клиента при динамической корректировке лимитов. Если корректировка приводит к снижению уровня маржи ниже минимального уровня, то данная корректировка будет отвергнута сервером
Откл. от цены закрытия для опер. Типа Short	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от цены закрытия предыдущей торговой сессии. Если значение отсутствует или отрицательно, то используется глобальная настройка. Нулевое значение отключает все ограничения цены операций «Short» для выбранного клиента (то есть проверка отклонения от текущей цены и от цены последней сделки для выбранного клиента также не будет производиться). Настройка не применяется для списка классов, по которым не будет осуществляться проверка ограничений на цены в заявках на открытие коротких позиций, указанных на странице «Ограничения на…/ Использование плеча»
Откл. от минимума из текущей цены и цены посл. Сделки, вошедшей в расчет текущ. Цены, для операций типа Short	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от наименьшей из двух цен: _ официальной текущей цены, сообщаемой торговой системой биржи; _ цены последней сделки, вошедшей в расчет текущей цены. Отклонение указывается в процентах. Если значение отрицательно, то проверка не выполняется. Если значение отсутствует, то используется глобальная настройка
Неполное неттирование денежных обязат.	Настройка работает при наличии у клиента нескольких денежных лимитов, текущие остатки которых суммируются при определении покупательной способности.

Параметр	Назначение
	Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования» и «Клиенты / Шаблоны / По «плечу»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования»
_ Отключено	Учёт параметра не производится. Значение по умолчанию
_ Только денег	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, клиенту будет увеличена маржинальная задолженность с целью ограничения возможности увеличивать текущие остатки на одних денежных лимитах за счёт увеличения маржинальной задолженности на других
_ Денег с учетом бумаг	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, активы клиента будут уменьшены на величину дисконта, примененного к задолженности по валюте, превышающей обеспечение в этой же валюте
Теги с неполным неттированием обязательств	Список тегов расчетов через запятую, при операциях по которым применяется неполное неттирование денежных обязательств. Если настройка не задана, то неполное неттирование денежных обязательств применяется к операциям по всем тегам расчетов, иначе – только по указанным в списке. Поле доступно для редактирования, если значение настройки «Неполное неттирование денежных обязат.» отлично от «Глобальная настройка» и «Отключено»
Не учитывать НКД при продаже облигаций	Разрешает не учитывать Накопленный купонный доход (НКД), возвращаемый продавцу при продаже облигаций, не увеличивая покупательную способность клиента на его денежном лимите при совершении сделки
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках», Часть 1 (см. п. 4.1)
Использовать корреляцию между инструментами	Включить для данного клиента индивидуальные настройки зависимостей между инструментами на разных рынках, используемые для расчета покупательной способности
_ Да	Использование корреляции разрешено, настройки зависимостей установлены на вкладке «Корреляция между инструм.». Если список не настроен (пустой), то это равносильно запрету использования
_ Нет	Использование корреляции запрещено

Параметр	Назначение
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Инструменты» (см. п. 8)
Использовать корреляцию для заявок	Включить для данного клиента учёт корреляции открытых позиций и активных заявок с выставляемой заявкой при проверке достаточности средств. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу», для которых включена настройка «Использовать корреляцию между инструментами»
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
Использовать единую бумажную позицию	Выбор режима учета единой бумажной позиции для клиента
_ Да	Использовать настройки, указанные на вкладке «Счета един. бум. позиции»
_ Нет	Не использовать настройки единой бумажной позиции
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Клиенты/Доп. теги расчетов» (см. п. 17)
Максимальный дневной убыток по счету	Настройка максимально допустимого значения дневного убытка по счету клиента. Значение задается в виде фиксированной суммы с указанием валюты или в виде процента от входящих средств клиента. При проведении операции происходит сравнение максимально допустимого значения убытка с разностью оценок входящих и текущих средств по счету клиента. Если убыток по счету больше допустимого, то операция запрещается (кроме операций закрытия позиций). При проведении оценки убытков все бумажные и денежные позиции клиента складываются и приводятся к валюте, в которой задано ограничение. Если ограничение задано в процентах, то пересчет происходит в «основную» валюту денежной позиции клиента. Входящие позиции по бумагам оцениваются по ценам закрытия, текущие позиции – по цене последней сделки. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу». При операциях ввода / вывода средств внутри дня, проведенных в виде коррекции текущих остатков, торговые операции могут становиться доступными или недоступными для клиента в зависимости от текущего значения убытков по счету клиента

Параметр	Назначение
_ значение	Допустимое значение убытка по счету в течение дня
_ тип ограничения	Выбор типа ограничения. Возможные значения: _ процент; _ фиксированный
_ валюта ограничения	Ввод кода валюты ограничения, например «SUR». Поле доступно, если тип ограничения – «фиксированный»
Ограничить покупку немаржинальных бумаг	Настройка ограничения на операции с немаржинальными бумагами:
_ Да	Используется ограничение на покупку немаржинальных бумаг в пределах остатка собственных средств, оставшихся свободными после покупки маржинальных бумаг. В качестве остатка собственных средств в расчет принимается только значение с денежного лимита по тегу и валюте текущей операции
_ Нет	Покупка маржинальных бумаг расценивается сервером как операция с «плечом», использующая частично собственные и частично заемные средства. Таким образом, при покупке клиентом маржинальных бумаг на величину всех своих средств у него могут остаться неизрасходованные собственные средства, доступные для покупки немаржинальных бумаг
_ Глобальная настройка	Определяется настройкой параметра «Ограничивать покупку немаржинальных бумаг» на странице «Настройки маржинального кредитования» см. п. 23
Разрешить марж. покупки на деньги от кор. поз.	Разрешает использование средств, полученных от открытия коротких позиций, на открытие маржинальных длинных позиций. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу»
_ Да	Использование разрешено
_ Нет	Использование запрещено
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках», Часть 2 (см. п. 4.2)
Общий лимит по деньгам и бумагам	Распространяется на клиентов с типом кредитования «По лимитам». Для включения настройки должна быть отключена проверка операций шорт (см. п. 22. «Ограничения на использование плеча»)
_ Да	Все маржинальные операции в сумме (и покупка на заёмные деньги, и шорт) ограничиваются величиной установленного клиенту денежного лимита. Величина лимитов по бумагам перестает учитываться. При включении настройки, также появляются следующие отличия в отображении операций клиента:

Параметр	Назначение
	маржинальные операции покупки уменьшают размер текущего денежного остатка на сумму задолженности перед брокером (текущий остаток становится отрицателен при покупке на заёмные средства), операции короткой продажи не изменяют отображаемых в таблицах лимитов по деньгам и по бумагам
_ Нет	Не использовать общий лимит по деньгам и бумагам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками признака, установленного в «Общих настройках», Часть 2 (см. п. 4.2). Выбрано по умолчанию
Контролировать позиции по валютам	Настройка позволяет контролировать максимальные допустимые размеры остатков (лонг, шорт) на денежных лимитах клиента отдельно по каждой валюте. Для корректной работы данной опции класс валютного инструмента должен быть прописан на странице «Классы» в поле «Вести денежные позиции в разрезе валют», а клиент должен иметь тип лимитирования «Лимит на открытую позицию»
_ Да	При включении настройки в таблице «Список коэффициентов по бумагам» можно задать ограничение на максимальный размер коротких и длинных позиций по валютам. Ограничение на длинную и короткую позицию по валюте задается в полях «Об. Long» и «Об. Short» соответственно отдельно для каждой валюты. При этом ограничения на валюту интерпретируется как ограничения на размер текущего остатка по валюте с учётом активных заявок. Оценка остатков на лимитах по бумагам не учитывается. Коэффициенты «Long» и «Short» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» не учитываются
_ Нет	Не контролировать позиции по валютам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
Расчет лимита от оборота	Дополнительный параметр при типе кредитования клиентов «Лимит на открытую позицию»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Нет	Учёт параметра не производится
_ Без возмещения	Установленный клиенту входящий лимит (колонка «входящий лимит» Таблицы денежных лимитов) интерпретируется как лимит на дневной оборот по операциям. В дневном обороте учитываются все сделки клиента по тегу расчётов, на который установлен входящий лимит, без учёта направления, с учётом коэффициента в поле «Long» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» (по умолчанию коэффициент

Параметр	Назначение
	«Long» равен 1). Валюта лимита должна совпадать с «валютой лимитов открытых позиций на инструменте» (настраивается в описываемой странице)
_ С возмещением	При совершении торговых операций, обратных по направлению к ранее совершенным в текущую торговую сессию операциям, значение текущего лимита восстанавливается (увеличивается), на объём совершённой операции, но не более суммы, списанной ранее
Ограничить вывод денежных средств	Настройка ограничения на вывод денежных средств. Действие настройки распространяется на сложные отчеты, если включена настройка «Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов». Действие настройки не распространяется на классы, указанные в параметре «Классы с игнорированием ограничения на вывод ДС»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Клиент может вывести только остаток денежных средств
_ Нет	Могут быть выведены средства в размере, превышающем собственный остаток в пределах свободных средств маржинального портфеля. Например, в схеме «по плечу»: если клиент, имея плечо 1 и 100 рублей на счете, сделает покупку на 90 рублей, то при включенном флажке ему дадут вывести только 10 рублей, а при выключенном – 55 рублей
Классы с игнорированием ограничения на вывод ДС	Список классов, для которых отменяется действие настройки «Ограничить вывод денежных средств». Если для вида лимита, отличного от Т0, список пуст, то используется список классов, заданный для вида лимита Т0 для данного клиента. Если для вида лимита Т0 список тоже пуст, то используется список классов, заданный на странице «Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования» независимо от состояния настроек «Ограничить вывод денежных средств» на этой странице и на странице для вида лимита Т0
Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов	Настройка определяет допустимость образования или увеличения задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета. Настройка задается для вида лимита Т0. Используется, если настройка «Ограничить вывод денежных средств» включена
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)

Параметр	Назначение
_ Да	Образование или увеличение задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета запрещено
_ Нет	Образование или увеличение задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета разрешено
Ограничить операции на срочном рынке	Настройка позволяет выбирать возможность торговли срочными инструментами в единой денежной позиции либо за счет только остатка собственных средств, либо за счет привлечения дополнительно заемных средств, вплоть до ограничительного уровня маржи
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Операции по покупке и продаже срочных контрактов при использовании модуля ЕДП возможны только за счет собственных денежных средств клиента
_ Нет	Операции по покупке и продаже срочных контрактов при использовании модуля единой денежной позиции возможны как за счет собственных средств клиента, так и за счет заемных средств клиента при условии, что данные операции не снижают уровень маржи ниже ограничительного
Запрещать открытие коротких позиций при нулевом входящем лимите	Настройка позволяет расширить действие аналогичной глобальной настройки на код клиента, шаблон клиентских кодов, префикс клиентского кода
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	При включении настойки открытие коротких позиций при нулевом входящем лимите невозможно
_ Нет	Учёт параметра не производится
Уровень ставки рыночного риска	Значение уровня ставки риска дисконтов КЦ. Возможные значения: неотрицательные целые числа. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Уровень ставки рыночного риска по классам» (см. п. 15)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Заданное значение	Поле для ввода значения уровня ставки риска. Значение по умолчанию: «3». Допустимая область значений: положительные целые числа

Параметр	Назначение
Использовать настроенные дисконты	Включение настройки позволяет брать в качестве эффективных дисконтов только собственные дисконты, настроенные в разделе «Диск. по бум.». Дисконты КЦ в этом случае игнорируются. Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ
Параметры корректировки минимальных дисконтов	Параметры, позволяющие клиенту задание коэффициентов, корректирующих значения минимальных дисконтов
_ Long	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по длинной позиции. Допустимая область значений: [0;1]
_ Short	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по короткой позиции. Допустимая область значений: [0;1]
Использовать дисконты КЦ	Настройка влияет на порядок определения эффективных дисконтов по инструменту. Использование данной настройки возможно совместно с настройкой «Использовать настроенные дисконты». Путем комбинации данных настроек устанавливается необходимый брокеру порядок выбора эффективных дисконтов в различных ситуациях Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ
Дополн. учитывать комиссии на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссии брокера и торговой системы по таким операциям учитываются не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов лимитов, то эти комиссии учитываются также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет больший приоритет, чем настройка «Дополн. учитывать комиссию ТС на лимите Т0»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Учет комиссии операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0
_ Нет	Учет не производится
Дополн. учитывать комиссию ТС на лимите Т0	Настройка влияет на учет операций по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0. При включенной настройке комиссия торговой системы по таким операциям учитывается не только на лимите операции, но и на лимите вида Т0. При этом комиссия брокера учитывается только на лимите операции. Если настройка «Проверять обязательства по видам лимитов» содержит несколько последовательных видов лимитов, то

Параметр	Назначение
	комиссия торговой системы учитывается также на всех лимитах с видом меньше вида лимита операции. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Дополн. учитывать комиссии на лимите Т0»
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Учет комиссии торговой системы по классам, привязанным к видам лимитов, отличным от Т0
_ Нет	Учет не производится
Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах	Используется, если включена хотя бы одна из настроек – «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» или «Доп. учитывать комиссию ТС на лимите Т0». Настройка влияет на проверку покупательной способности для клиентов с типом кредитования «по плечу», «по дисконтам» и «МД+». При включенной настройке заявки отвергаются, если, с учетом комиссии по выставляемой заявке, оценка текущих активов клиента на лимите Т0 становится отрицательной. При отключенной настройке для клиентов с типом кредитования «по плечу» блокировка и списание комиссии на лимите Т0 проверяется до ограничительного уровня маржи на лимите Т0, а для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» проверяется, что стоимость портфеля превышает значение вычисляемой скорректированной маржи
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию
_ Да	Проверка комиссии на лимите Т0
_ Нет	Проверка не производится
Игнорировать проверку комиссии в Т0 при закрытии позиции	Настройка требует включения настройки «Дополнительно учитывать комиссии на лимите Т0» и перекрывает действие настройки «Отвергать заявки маржинальных клиентов только при отрицательных активах» для заявок на закрытие позиции. Поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке отключается проверка достаточности средств под комиссию на лимите Т0 при проверке заявок, сокращающих модуль позиции по инструменту на лимите по плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов»). При этом блокировка комиссии на лимите Т0 по заявке и ее списание по сделке все равно выполняется
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными в «Общих настройках», Часть 5 (см. п. 4.5). Выбрано по умолчанию

Параметр	Назначение
_ Да	Отключение проверки комиссии на лимите Т0
_ Нет	Настройка не используется
Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится по списку лимитов, перечисленных в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов», начиная с вида лимита, к которому привязан инструмент, класс или код расчётов. Для текущего проверяемого вида лимита используются наборы дисконтов, если такие дисконты настроены (можно использовать разные дисконты в разрезе видов лимитов). При отключенной настройке, по умолчанию, контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится только на лимите плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов»)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Выполнить проверку
_ Нет	Проверка не производится
Запрет маржинальных покупок	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке, сервер QUIK отклоняет заявки на покупку маржинальных бумаг, перечисленных в списке «Обеспечение» (см. п. 32.1), если объем заявки превышает текущий свободный остаток собственных денежных средств клиента по тегу и валюте расчетов. При отключенной настройке такая проверка не производится
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Запретить маржинальные покупки
_ Нет	Разрешить маржинальные покупки
Использовать портфельное ГО	Включение / выключение режима ПГО для отдельных клиентов (см. п. 1.1 Описания настроек ПГО)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Учет операций срочного рынка» (см. п. 18). Значение по умолчанию
_ Да	Использовать портфельное ГО
_ Нет	Не использовать портфельное ГО

Параметр	Назначение
Проверять продажу актива за немаржинальную валюту как вывод средств	Настройка поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Включение настройки позволяет запретить выставление заявок на продажу актива, входящего в обеспечение, если исполнение таких заявок приводит к ситуации УДС < 1. Требование запрета распространяется на такие продажи актива, в результате которых в портфель клиента приходит немаржинальная валюта
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется
Контроль операций РЕПО/РПС по отчету на исполн.	Включает проверку операций РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S0» и «B0») на лимите T0 при подаче отчета на исполнение первой части (для сделок РЕПО) и отчета на исполнение (для сделок РПС)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется
Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок	Настройка влияет на операции РЕПО с кодом расчётов S0 и РПС с кодом расчетов B0. Если список «Классы расчета лимитов для внебиржевых заявок» (см. п. 15) содержит значения, то настройка влияет только на операции по классам бумаг, указанным в списке, иначе – на операции всех классов РЕПО и РПС с указанными кодами расчетов. Если выбрано значение «Нет», то проверка достаточности средств на лимите T0 при подаче заявок в указанных режимах не выполняется, проверка и блокировка лимитов осуществляются только на лимитах T1, T2 и т.д. Расчёты по сделке учитываются на лимитах T1, T2 и т.д. сразу при заключении сделки. На лимите T0 проверка, блокировка и списание средств производятся при подаче отчёта по сделке для исполнения и её подтверждении отчётом со стороны партнёра. Если выбрано значение «Да», то на видах лимитов T0, T1, T2 и т.д. проверка и блокировка средств производятся при подаче заявок в указанных режимах. Расчёты по сделке для лимитов T1, T2 и т.д. производятся непосредственно при заключении сделки, а для лимита T0 – при подтверждении обеими сторонами сделки для исполнения
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Общие параметры» в разделе «Общие настройки библиотеки. Часть 3» (см. п. 4.3). Значение по умолчанию

Параметр	Назначение
_ Да	Проверка осуществляется
_ Нет	Проверка не осуществляется
Классы расчета лимитов для внебиржевых заявок	Список классов инструментов (через запятую), по которым осуществляется проверка достаточности средств при подаче заявок РЕПО и РПС (с кодами расчетов «S*» и «B*»). Проверка осуществляется при включенном флажке «Рассчитывать лимиты для внебиржевых заявок» (см. п. 15). Если список классов не задан, проверка достаточности средств выполняется по всем классам
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Классы» (см. п. 7)
_ Заданное значение	Поле для указания списка классов инструментов через запятую
Неттинг риска валютных позиций в скорр. марже	Включение настройки позволяет использовать особую логику учета валютных позиций в скорректированной марже, при которой риск текущей валютной позиции компенсируется за счет учета этого риска в оценке потенциальной позиции по инструменту заявки с большим дисконтом. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Данный алгоритм не следует использовать для инструментов, которые торгуются в разных режимах торгов в разных валютах. Корректность расчетов при работе с такими инструментами не гарантируется. Данная настройка не поддерживается для операций в режимах торгов, указанных в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы» (см. п. 7)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Неттинг осуществляется
_ Нет	Неттинг не осуществляется
Определение ставки риска фьючерса из ГО	Настройка может использоваться для определения дисконтов КЦ по фьючерсам исходя из размера ГО, транслируемого торговой системой. Для положительной позиции используется ГО покупателя, для отрицательной – ГО продавца. Если задана настройка «Ограничение цены фьючерса для расчета риска» (см. п. 23) и рыночная цена фьючерса по модулю ниже заданного в настройке значения, то для определения ставки риска фьючерса используется значение цены, заданное в настройке. При невозможности расчета дисконт КЦ считается равным 1.

Параметр	Назначение
	Рассчитанное значение может использоваться для расчета эффективных дисконтов. Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «МД+». Настройка имеет более высокий приоритет относительно глобальной настройки, задаваемой на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальной настройкой, установленной на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Да	Использовать ГО
_ Нет	Не использовать ГО
Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме МД+	Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме «МД+». О расчете минимальной маржи см. в Комментарии 3 к п. 23. Значение по умолчанию: «0,5»
Тип неттинга по умолчанию в МД+	Тип неттинга рисков по умолчанию для множеств инструментов с зависимыми ценами в схеме МД+. Приоритет выбора типа неттинга см. в Комментарии к п. 8.9
_ Глобальная настройка	Определяется глобальными настройками, установленными на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Полунеттинг	Требования к обеспечению определяются как максимальная величина риска между суммарными оценками положительных и отрицательных позиций по активам множества
_ Неттинг	Требования к обеспечению определяются по суммарной оценке всех активов множества
_ Активы в разных валютах в множествах МД+	Признак допустимости включения активов, цена которых выражена в разных валютах, во множества инструментов с зависимыми ценами в схеме «МД+». При использовании параметра не гарантируется соблюдение требований Указания Банка России № 5636-У. Настройка имеет более высокий приоритет относительно глобальной настройки, задаваемой на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23)
_ Глобальная настройка	Определяется глобальной настройкой, установленной на странице «Ограничения на…/ Настройки маржинального кредитования» (см. п. 23). Значение по умолчанию
_ Да	Включать активы с ценой в разных валютах во множества
_ Нет	Не включать активы с ценой в разных валютах во множества

Параметр	Назначение
Вкладка «Коэф. по бум.»	
Список коэффициентов по бумагам	Настройка коэффициентов кредитования ресурсами при продаже или покупке соответствующего инструмента, а также для задания максимального размера обеспечения по данной бумаге
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента
_ Long	Коэффициент оценки длинной позиции по данному инструменту
_ Short	Коэффициент оценки короткой позиции по данному инструменту
_ Об. Long	Максимальный размер позиции по данной бумаге, учитываемый в обеспечении маржинальных сделок, в валюте инструмента
_ Об. Short	Максимальный размер короткой позиции по данной бумаге, в валюте инструмента
_ % откл. диск.	Параметр контроля условий для заявок в режиме РЕПО-М, устанавливающий: _ Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и нижним дисконтом для заявок на покупку; _ Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и верхним дисконтом для заявок на продажу
Вкладка «Диск. по бум.»	
Список дисконтов по бумагам	Установка дисконтов кредитования ресурсами при продаже или покупке по выбранной бумаге. Настройка применяется для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13. Если для лимитов вида Т1, Т2 и т.д. дисконты на вкладке «Дисконты по бумагам» не установлены, то используются дисконты, установленные на данной вкладке для лимита вида Т0. Если дисконты для лимита вида Т0 не установлены, то используются глобальные дисконты. Приоритет настроек дисконтов по бумагам см. в комментарии к п. 13
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента. Для фьючерсов при использовании схемы «МД+» в качестве значения может быть задан префикс в формате «<префикс>*»
_ Д long	Значение дисконта брокера для длинной позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ Д short	Значение дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13

Параметр	Назначение
_ Д min long	Значение минимального дисконта брокера для длинной позиции по данному инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ Д min short	Значение минимального дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ К long	Коэффициент ставки риска длинной позиции по данному инструменту. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
_ К short	Коэффициент ставки риска короткой позиции по данному инструменту. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13
Вкладка «Уровень рыночного риска»	
Уровень ставки рыночного риска по классам	Диапазон используемых дисконтов КЦ в разрезе классов оценки. Настройка доступна только для лимитов вида Т0. Если класс, в котором оценивается инструмент, не добавлен в данную настройку, то для него используется настройка «Уровень ставки рыночного риска»
_ Уровень ставки	Номер диапазона дисконтов КЦ. Возможные значения: от 0 до 255
_ Список классов	Список классов через запятую
Вкладка «Теги для реж. Торг.»	
Теги для режимов торгов	Настройка соответствия тегов расчётов и классов инструментов. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Другие параметры»
_ Теги расчётов для режимов торгов	Список тегов. Подробное описание настройки и список значений по умолчанию см. в Комментарии к п. 5
_ Список классов	Список классов инструментов для данного тега расчетов, разделенный запятыми
Вкладка «Теги, опр. по коду инстр.»	
Теги, определяемые по коду инструмента	Настройка соответствия тегов расчетов и кодов инструментов. Настройка имеет более высокий приоритет по сравнению с аналогичной настройкой на странице «Доп. теги расчетов»

Параметр	Назначение
_ Теги, определяемые по коду инструмента	Список тегов
_ Список инструментов	Коды инструментов, разделенные запятыми, позиции по которым включаются в расчет входящего и текущего лимитов по заданному тегу расчетов, например, «LKOH, RTKM»
Вкладка «Корреляция между инструм.»	
Корреляция между инструментами	Индивидуальные настройки зависимостей между инструментами. Используются, если параметр «Использовать корреляцию между инструментами» имеет значение «Да». Параметры задаются аналогично глобальной настройке, расположенной на странице «Инструменты» (см. п. 8)
Вкладка «Счета един. бум. позиции»	
Счета един. бум. позиции	Настройка предназначена для суммирования позиций по инструментам (с учетом знака) с разных торговых счетов при расчёте покупательной способности. Настройки используются, если параметру «Использовать единую бумажную позицию» присвоено значение «Да»
_ Теги	Тег расчетов, например, «EQTV»
_ Список счетов	Список торговых счетов через запятую. Допустимо использование префикса, например «L01*»
Вкладка «Прив. классов к видам лимитов»	
Привязка классов к видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия между видами лимитов и классами ценных бумаг для определения вида лимита текущей операции, аналогично глобальной настройке на странице «Общие настройки библиотеки. Часть 5» (см. п. 4.5). Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «T», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания. Значение по умолчанию: «T0»
_ Классы	Список классов инструментов, перечисленных через запятую
Вкладка «Прив. инстр. к видам лимитов»	
Привязка инструментов к видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия инструмента и вида лимита, начиная с которого отражается операция,

Параметр	Назначение
	аналогично глобальной настройке, описанной на странице «Инструменты» (см. п. 8.2). Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «Т», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания. Если в качестве значения использована пустая строка или вид лимита, который не задан настройкой «Проверять обязательства по видам лимитов», при сохранении нажатием кнопки «Принять» выдается соответствующее предупреждение; сохранение и закрытие окна редактора отменяется. Если не заданы инструменты, строка сохраняется.
_ Инструменты	Список инструментов, перечисленных через запятую
Вкладка «Прив. код. расч. к класс. и вид. лим.»	
Привязка кодов расч. к классам и видам лимитов	Настройка предназначена для индивидуальной настройки соответствия кодов расчетов виду лимита и классам, аналогично глобальной настройке, описанной на вкладке «Классы» (см. п. 7). Настройка используется только для адресных режимов торгов и режимов РЕПО с ЦК. Одна и та же пара значений «Код расчётов»–«Класс» не может быть поставлена в соответствие разным видам лимита. Приоритет настроек «Привязка инструментов к видам лимитов», «Привязка классов к видам лимитов» и «Привязка кодов расчетов к классам и видам лимитов» см. в Комментарии в п. 13
_ Вид лимита	Вид лимита. Допускается ввод значений, начинающихся с латинского символа «Т», за которым следует натуральное число. Виды лимитов указываются в порядке их возрастания
_ Классы	Список классов инструментов, перечисленных через запятую
_ Коды расчётов	Список кодов расчётов, перечисленных через запятую
Вкладка «Классы со списанием средств в Т0»	
Классы со списанием средств в Т0	Настройка используется для операций, которые учитываются на видах лимита, отличных от Т0. Если класс операции указан в настройке, то по сделкам, совершаемым клиентом с инструментами этого класса, блокировка и списание активов дополнительно производятся на всех предыдущих видах лимита, начиная с Т0. Зачисление активов на дополнительные виды лимита при этом не производится.

Параметр	Назначение
	Например, на видах лимита, предшествующих тем, где учитываются операции, для сделок покупки производится только списание денежных средств с позиции по деньгам (без учета комиссий брокера и торговой системы), а для сделок продажи – только списание количества в сделке с позиции по инструменту. Допускается указывать только классы спот- и РПС-операций на фондовом рынке. Настройку нельзя использовать совместно с настройкой «Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов», если предполагается совершение операций с расчетами в Т0
Вкладка «Множества с зависимыми ценами»	
Множества инструментов с зависимыми ценами	Данная настройка позволяет объединить инструменты с зависимыми ценами, выраженными в одной валюте, во множества с целью снижения размера маржи при работе по схеме кредитования «МД+». Но если включен параметр «Активы в разных валютах в множествах МД+», то во множества могут быть объединены инструменты, цена которых выражена в разных валютах. Настройка имеет более высокий приоритет относительно глобальной настройки, задаваемой на странице «Инструменты» (см. п. 8.9)
Множества	В настройке определяются множества инструментов с зависимыми ценами
_ Наименование	Наименование множества. Может содержать латинские буквы и цифры без пробелов. Обязательный параметр
_ Базовый индикатор	Код инструмента, относительно которого определяется риск. Базовый индикатор входит во множество по умолчанию, при этом для него зависимость всегда прямая, а относительная ставка риска равна нулю
_ Тип неттинга	Тип неттинга рисков между активами множества в схеме МД+. Возможные значения: _ «По умолчанию» (по умолчанию); _ «Полунеттинг» – требования к обеспечению определяются как максимальная величина риска между суммарными оценками положительных и отрицательных позиций по активам множества; _ «Неттинг» – требования к обеспечению определяются по суммарной оценке всех активов множества. Приоритет выбора типа неттинга см. в Комментарии к п. 8.9
Состав множества	
_ Инструмент	Список кодов инструментов, входящих во множество. Один инструмент может входить только в одно множество

Параметр	Назначение
_ Относительная ставка риска	Ставка риска относительно базового индикатора. Задается в долях единицы с точностью 8. Возможные значения: от 0 до 1. Значение по умолчанию: «1»
_ Зависимость	Направление зависимости. Возможные значения: _ «Прямая»; _ «Обратная»
Использовать глобальные множества при расчете маржи	Настройка включает учет множеств инструментов из глобальной настройки, заданной на странице «Инструменты» (см. п. 8.9), при расчете маржи для клиентов, указанных в данном шаблоне. Если настройка включена, и заданы множества на глобальном уровне и в шаблоне, то настройки объединяются. При этом множества в шаблоне, у которых наименования совпадают с глобальными множествами, переопределяют эти глобальные множества. Если в глобальных и шаблонных множествах с разными наименованиями пересекаются инструменты, то такие инструменты в целях расчета маржи исключаются из глобального множества. Если исключаемый инструмент является базовым индикатором глобального множества, такое множество не учитывается. Если настройка выключена, то при расчете маржи используются множества инструментов, заданные в данном шаблоне
Вкладка «Инструменты без валютного риска»	
Инструменты без учета валютного риска	Классы и инструменты, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Настройка выполняется для лимитов вида Т0, но ее значение учитывается для операций с любым видом лимита
Классы	Список классов инструментов, для которых при расчете маржи не требуется рассчитывать валютный риск. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить». При этом могут быть выбраны все классы (при выборе этого варианта в списке появится значение <ALL>) или наименование из списка. В качестве классов следует указывать только те, в которых может оцениваться портфель (перечисленные в настройке «Список классов для оценки портфеля», см. п. 7)
Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ Все инструменты	Все инструменты класса
_ По списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми
Вкладка «Учет операций РЕПО»	

Параметр	Назначение
Классы адресного РЕПО с учетом второй части по сделке	Список классов РЕПО-М и адресного РЕПО с ЦК, для которых по заявке и сделке на позициях клиента, по сроку расчетов соответствующих второй части, учитываются комиссия и разница между суммой выкупа РЕПО и суммой РЕПО. Используемые сроки расчетов (виды лимита) должны покрывать обе части сделки. Не поддерживается возможность отказа от исполнения сделки РЕПО: в случае отказа от исполнения брокеру необходимо скорректировать лимиты. Настройка отменяет действие настроек «Игнорировать срок расчетов РЕПО с ЦК» и «Рассчитывать обязательства РЕПО/РПС по всем видам лимитов»
Вкладка «Оценка портфеля»	
Список классов для оценки портфеля	Список классов инструментов (через запятую), используемых для оценки активов клиентов, и очередность их использования. Может применяться для установки приоритета какого-либо класса, если одни и те же инструменты торгуются в нескольких классах – приоритет классов в списке уменьшается слева направо. Данный список классов ограничивает отображение инструментов в таблице «Купить/продать» в Рабочем месте QUIK. Настройка имеет более высокий приоритет относительно глобальной настройки, задаваемой на странице «Классы» (см. п. 7). Если настройка не задана, то используется список классов, формируемый глобальными настройками «Список классов для оценки портфеля» и «Дополнительные классы для оценки портфеля». Настройка не учитывается при расчете портфельного гарантийного обеспечения

Комментарий

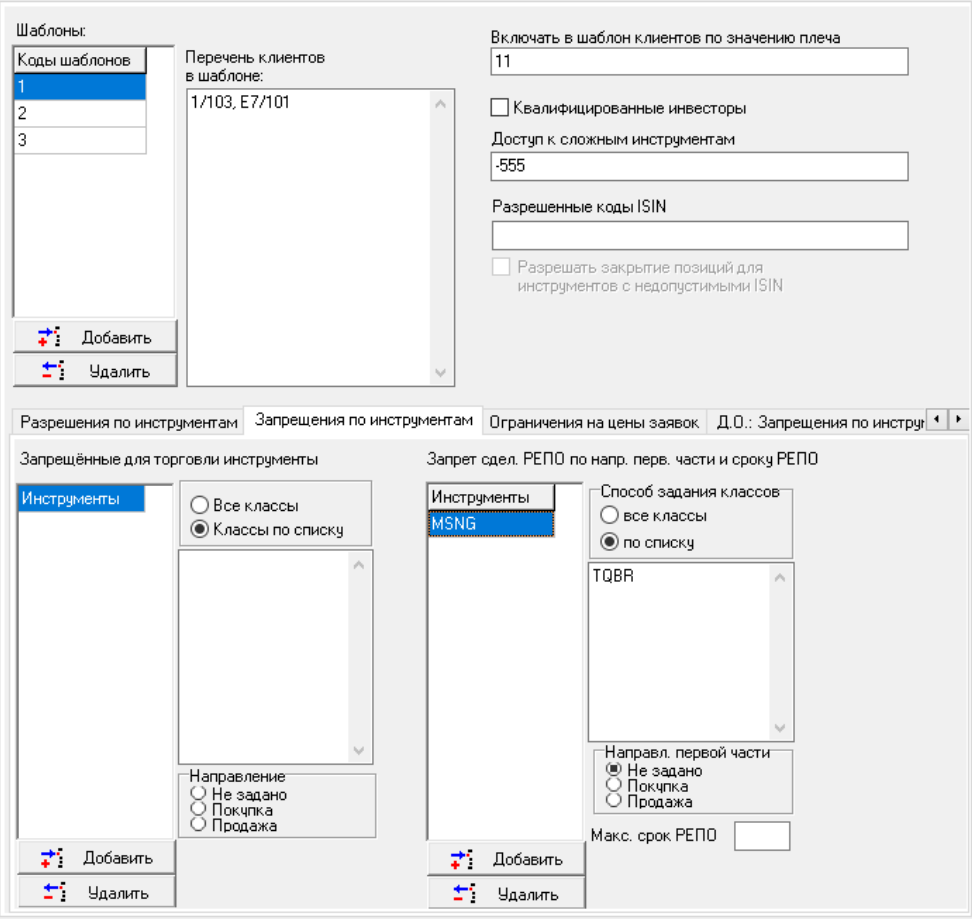
Приоритет выбора шаблона «По "плечу"»:

1. Настройки по шаблону, в котором значение поля «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча» совпадает со значением последнего заданного плеча на денежном лимите клиента (см. на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"», п. 15). Учитывается только для клиентов с типом кредитования «По дисконтам» или «МД+».
2. Индивидуальные настройки, заданные на вкладке «Клиенты / Настройки "плеча"» (см. п. 13).
3. Настройки по шаблону для нескольких кодов клиентов, заданному на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"» (см. п. 15).
4. Настройки для группы клиентов, заданные на вкладке «Клиенты / Настройки "плеча"» по префиксу кода клиента (см. п. 13).

Если ни одна из вышеперечисленных настроек для клиента не задана, то используются глобальные настройки.

16. Клиенты / Шаблоны / По ограничениям

Страница предназначена для формирования шаблонов настроек ограничений по разрешенным и запрещенным для торговли бумагам, а также для просмотра и редактирования списка клиентов, к которым применяется выбранный шаблон.



Параметр	Назначение
Шаблоны	Список сохраненных шаблонов
Перечень клиентов в шаблоне	Список кодов клиентов через запятую, к которым применяется данный шаблон. Допускается указание только полных кодов клиентов. Указание префиксов кодов клиентов с символом * на конце недопустимо. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1)

Параметр	Назначение
Включать в шаблон клиентов по значению плеча	Список значений плеча через запятую, к которым применяется данный шаблон. Значение указывается с точностью до двух знаков после десятичного разделителя. Настройки шаблона применяются для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Не допускается указание одного и того же значения плеча в нескольких шаблонах по ограничениям. Плечо задается на денежном лимите клиента в Рабочем месте QUIK. Рекомендуется использовать одинаковые значения плеча на всех лимитах. Подробнее см. в Комментарии 1 к аналогичной настройке в п. 14. Приоритет выбора шаблона «По ограничениям» см. в Комментарии. По умолчанию настройка не задана
Квалифицированные инвесторы	Признак того, что все клиенты в шаблоне являются квалифицированными инвесторами. По умолчанию флажок выключен
Доступ к сложным инструментам	Список идентификаторов типов сложных инструментов через запятую, с которыми клиентам, включенным в шаблон, доступны операции. Параметр имеет меньший приоритет, чем параметр «Клиенты с доступом к сложным инструментам», заданный на код клиента
Разрешенные коды ISIN	Список кодов ISIN инструментов через запятую, операции с которыми разрешены. Значение в списке также может быть задано в виде префикса с символом «*» в формате «<префикс>*». Параметр не учитывается для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции, а также для операций на валютном и срочном рынках. Параметр имеет более высокий приоритет относительно глобального параметра, задаваемого на странице «Ограничения на / Доступные бумаги» (см. п. 25)
Разрешать закрытие позиций для инструментов с недопустимыми ISIN	Признак разрешения операций закрытия по инструментам, коды ISIN которых не указаны в параметре «Разрешенные коды ISIN». Параметр имеет более высокий приоритет относительно глобального параметра, задаваемого на странице «Ограничения на / Доступные бумаги» (см. п. 25)
Вкладка «Разрешения по инструментам»	
Разрешенные для торговли инструменты	Настройка списка инструментов, разрешенных клиенту для совершения торговых операций. Настройка ограничивает список разрешенных для торговли инструментов только явно заданными в ней инструментами и классами. При этом разрешение на торговлю в данной

Параметр	Назначение
	настройке может быть перекрыто запрещением в другой настройке, например, в шаблоне «по комиссии»
_ Бумага	Код инструмента, разрешенного клиенту для проведения торговых операций. Новый инструмент добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом кода бумаги. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>
_ Все классы	На все классы для указанного инструмента
_ Классы по списку	На классы из списка внизу. Коды классов указываются через запятую
*Ограничение сделок РЕПО по направлению первой части	Настройка ограничения списка инструментов для операций РЕПО по направлению первой части сделки РЕПО. Ограничение доступно для классов «РЕПО» и «РЕПО с ЦК». Для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» данная настройка не учитывается. Все поля данной настройки обязательны для заполнения
_ Классы	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка. Допускается указание только класса с признаком «Класс РЕПО» или «РЕПО с ЦК», для других классов ограничение не действует
_ Список инструментов	Список инструментов указанного класса через запятую. Для перечисленных инструментов подача заявок разрешена, для остальных инструментов класса – запрещена. Для запрета операций по всем инструментам выбранного класса необходимо указать код отсутствующего в классе инструмента, например фиктивный код «XYZ»
_ Направление	Направление первой части РЕПО. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа». Для каждого из значений можно задать список бумаг для одного и того же класса (не более одного списка для каждого направления)
Вкладка «Запрещения по инструментам»	
**Запрещенные для торговли инструменты	Настройка списка инструментов, запрещенных клиенту для совершения торговых операций. В настройке указывается код инструмента либо его ISIN. Настройка ограничивает список запрещенных для торговли инструментов только явно заданными в ней инструментами и классами, а также направлением заявки. При этом запрещение на торговлю в данной настройке не может быть

Параметр	Назначение
	перекрыто никаким другим разрешением, в том числе настройками на вкладке «Разрешения по инструментам», описанными выше
_ Инструмент	Код инструмента, запрещенного клиенту для проведения торговых операций. Новый инструмент добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом кода инструмента. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>
_ Все классы	На все классы для указанного инструмента
_ Классы по списку	На классы из списка ниже. Коды классов указываются через запятую
_ Направление	Направление заявки, которая должна быть запрещена для заданного инструмента в заданном режиме (режимах). Возможные значения: _ «Не задано» (по умолчанию); _ «Покупка» – запрет распространяется на заявки на покупку; _ «Продажа» – запрет распространяется на заявки на продажу
***Запрет сделок РЕПО по направлению первой части и сроку РЕПО	Запрет операций с определенными инструментами как с учетом направления сделки первой части, так и с учетом срока РЕПО. Настройка действует только для классов, имеющих признак «Класс РЕПО» и/или «Класс модифицированного РЕПО» и/или «РЕПО с ЦК». Если для пользователя включены настройки «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции, или «Игнорировать проверку для адресных заявок» (учитывается только в случае подачи адресной заявки), то данная настройка для него не учитывается
_ Инструменты	Список кодов инструментов, на которые действует ограничение. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>
_ Способ задания классов	Способ задания классов, на которые действует ограничение
_ Все классы	Ограничение действует для всех классов РЕПО, в которых торгуется заданный инструмент
_ По списку	Список классов через запятую, на которые действует ограничение
_ Направление первой части	_ «Не задано» (по умолчанию); _ «Покупка»; _ «Продажа»

Параметр	Назначение
_ Макс. срок РЕПО	Максимально допустимый срок РЕПО (если срок сделки больше указанного, операция запрещена), задается целым числом
Вкладка «Ограничения на цены заявок»	
Ограничение на цены заявок по времени	Настройка позволяет задать максимально допустимое отклонение цены заявки от центра диапазона цен в разрезе классов, инструментов, а также в зависимости от времени. При использовании в качестве центра диапазона лучших цен спроса и предложения нижняя граница диапазона вычисляется на основании лучшей ценой спроса, верхняя – лучшей цены предложения. Если значение центра диапазона цены для инструмента и класса заявки отсутствует или равно нулю (т.е. не может быть определено), то в целях проверки используется цена закрытия по инструменту и классу заявки. Если в качестве центра диапазона используются лучшие цены спроса и предложения, то цена закрытия используется при отсутствии как одной из цен, так и обеих одновременно. Исключение составляют случаи, когда отсутствует только одна из цен спроса или предложения, а цена закрытия не позволяет корректно определить допустимый интервал (цена закрытия меньше лучшей цены спроса при отсутствии цены предложения или цена закрытия больше лучшей цены предложения при отсутствии цены спроса); в такой ситуации цена закрытия не используется, считается, что она отсутствует. Если цена закрытия отсутствует или равна нулю, то в качестве центра диапазона используется значение референсной цены, заданной для инструмента в настройке «Референсная цена». При этом значения референсной цены и цены заявки в случае необходимости приводятся к одной валюте с использованием текущего кросс-курса Сервера QUIK для соответствующих валют. Если в качестве центра диапазона используются лучшие цены спроса и предложения, то референсная цена используется при отсутствии как одной из цен, так и обеих одновременно. Исключение составляют случаи, когда референсная цена не позволяет корректно определить допустимый интервал при отсутствии только одной из цен спроса или предложения (референсная цена меньше лучшей цены спроса при отсутствии цены предложения или референсная цена больше лучшей цены предложения при отсутствии цены спроса); в такой ситуации референсная цена не используется, считается, что она отсутствует. Если используется настройка «Соответствия классов для проверки ограничений цен» и для класса заявки задан один или несколько классов-экспортёров, то используется подходящее

Параметр	Назначение
	значение центра диапазона по классу-экспортёру, а не по классу заявки. Если для фьючерса задана настройка «Ограничение цены фьючерса для расчета риска» (см. п. 23) и текущий центр диапазона по модулю меньше, чем значение, заданное в настройке, то ограничение цены проверяется относительно текущего центра диапазона, а сам диапазон допустимых значений определяется исходя из значения ограничительной цены. То есть диапазон определяется следующим образом: [Центр диапазона – Ограничительная цена * Отклонение; Центр диапазона + Ограничительная цена * Отклонение]. Ограничения устанавливаются для параметров и их сочетаний: «Класс», «Класс» + «Инструмент», «Класс» + «Период», «Класс» + «Инструмент» + «Период». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретного сочетания параметров «Класс», «Инструмент» и «Период» задано в данной настройке, то оно отменяет ограничение, заданное на такое же сочетание параметров в глобальной настройке (см. п. 20).
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Допускается использование значения <ALL>, если настройка должна применяться ко всем классам.
_ Отклонение	Максимально допустимое отклонение цены заявки от центра диапазона цен в процентах. Параметр не обязателен для заполнения. Отсутствие значения параметра означает отсутствие ограничения
_ Центр диапазона цен	Выбор параметра, относительно значения которого вычисляется диапазон допустимого отклонения цен заявок. Возможные значения: _ «ср.-взвеш.» – текущая средневзвешенная цена; _ «последняя» (по умолчанию) – цена последней сделки; _ «открытия» – цена открытия; _ «рыночная» – рыночная цена вчерашнего дня; _ «закрытия» – цена закрытия; _ «теор. цена» – теоретическая цена опциона; _ «спрос/предл.» – лучшие цены спроса и предложения. Для операций РЕПО на отклонение проверяется цена первой части сделки. Для операций РЕПО с ЦК на отклонение проверяется ставка РЕПО, поэтому необходимо убедиться, что в качестве значения

Параметр	Назначение
	выбранного параметра торговой системой транслируется ставка РЕПО, а не цена. Если выбранный параметр не транслируется торговой системой, то используется параметр «Цена закрытия»
_ Отклонять заявку	Действие при отсутствии центра диапазона: _ «Да» – отклонять заявку; _ «Нет» (по умолчанию) – считать проверку успешной
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение цены заявки действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение цены заявки. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
_ Начало периода	Время начала периода, в течение которого действует ограничение цены заявки, в формате <ЧЧ:ММ>. Значение по умолчанию: «00:00». Поле необязательно для заполнения
_ Конец периода	Время окончания периода, в течение которого действует ограничение цены заявки, в формате <ЧЧ:ММ>. Указанное значение может быть меньше, чем значение, заданное в поле «Начало периода». Значение по умолчанию: «23:59». Поле необязательно для заполнения
Вкладка «Д.О.: Запрещения по инструментам» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций. Набор параметров и их назначение аналогичны параметрам на вкладке «Запрещения по инструментам». Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Ограничения объема заявок»	
Ограничения на максимальный объем заявок по классам	Содержит список индивидуальных ограничений для различных классов. Все строки в данной настройке имеют равный приоритет. Если величина объёма в проверяемой заявке нарушает хотя бы одно из ограничений, заявка будет отклонена. Общая для всех клиентов аналогичная настройка «Ограничения на максимальный объём заявок по классам» на странице «Ограничения на … / Объем заявок» (см. п. 28) проверяется совместно с настройкой из шаблона «по ограничениям» следующим образом. Для классов, явно указанных в настройке из шаблона, проверяются ограничения только из шаблона. Если в настройке из шаблона класс не указан, то для него проверяются ограничения из общей настройки. Это же касается варианта, когда вместо списка классов указано значение <ALL>

Параметр	Назначение
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Допускается использование значения <ALL>, если настройка должна применяться ко всем классам.
_ Объём	Размер ограничения для заявок по инструментам указанного класса. Допускается пустое значение - ограничение на объём заявки отсутствует.
_ Валюта	Валюта, в которой устанавливается размер ограничения для заявок. Допускается пустое значение - ограничение рассчитывается в валюте расчётов. При конвертации используются значения кросс-курсов сервера QUIK.
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на максимальный объем заявок действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на максимальный объем заявок. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
_ Начало периода	Время начала периода, в течение которого действует ограничение на максимальный объем заявок, в формате <ЧЧ:ММ>
_ Конец периода	Время окончания периода, в течение которого действует ограничение на максимальный объем заявок, в формате <ЧЧ:ММ>. Допускается указывать значение конца периода меньшее, чем значение начала периода.
Ограничения на минимальный объем заявок по классам	Содержит список индивидуальных ограничений для различных классов. Все строки в данной настройке имеют равный приоритет. Если величина объёма в проверяемой заявке нарушает хотя бы одно из ограничений, заявка будет отклонена. Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в данной настройке, то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в глобальной настройке (см. п. 7).
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Допускается использование значения <ALL>, если настройка должна применяться ко всем классам.

Параметр	Назначение
_ Объём	Размер ограничения для заявок по инструментам указанного класса. Допускается пустое значение - ограничение на объём заявки отсутствует.
_ Валюта	Валюта, в которой устанавливается размер ограничения для заявок. Допускается пустое значение - ограничение рассчитывается в валюте расчётов. При конвертации используются значения кросс-курсов сервера QUIK.
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на минимальный объем заявок действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на минимальный объем заявок. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Ограничения позиции»	
Ограничение максимального размера позиции	Настройка позволяет задать ограничения максимального размера позиции в разрезе инструментов для длинных и коротких позиций, действующие на одного клиента. Ограничение может быть настроено на любой актив фондового, валютного или срочного рынка. Ограничения по срочным инструментам и валютам (на код валюты) задаются в штуках. Ограничения по бумагам (включая валютные пары в инструментальной валютной схеме) задаются в штуках или в лотах в зависимости от значения настройки «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Ограничения в данной настройке переопределяют ограничения из глобальной настройки на странице «Ограничения на… / Объем заявок» (см. п. 28), заданные на тот же инструмент. Ограничения на инструменты, перечисленные в данной настройке по шаблону, но отсутствующие в глобальной настройке, дополняют глобальную настройку. Настройка не поддерживается для схем кредитования «Лимит на открытую позицию» (МОП) и «По лимитам», а также для бинарных опционов. Ограничения данной настройки не проверяются при выполнении операции закрытия позиции.
_ Инструменты	Список кодов инструментов через запятую. Параметр обязателен для заполнения

Параметр	Назначение
_ Огр. длин. поз.	Максимальный допустимый размер длинной позиции. Поле необязательно для заполнения
_ Огр. корот. поз.	Максимальный допустимый размер короткой позиции. Поле необязательно для заполнения
Вкладка «Ограничения кол. в заяв.»	
Ограничение максимального количества в заявке	Контроль максимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. При проверке игнорируется опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Общая для всех клиентов аналогичная настройка «Ограничение максимального количества в заявке» на странице «Классы» (см. п. 7) проверяется совместно с данной настройкой из шаблона «по ограничениям». Настройки в шаблоне проверяются в первую очередь. Если ни одно из ограничений в шаблоне не нарушено, то проверяются глобальные ограничения. Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в данной настройке, то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в глобальной настройке (см. п. 7).
_ Классы	Список классов бумаг, для которых задается максимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиента. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Количество	Максимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, больше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то ограничения нет
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение максимального количества в заявке действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение максимального количества в заявке. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Ограничение минимального количества в заявке	Контроль минимально допустимого количества лотов в заявке на инструмент. При проверке игнорируется опция «Рассчитывать

Параметр	Назначение
	позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Общая для всех клиентов аналогичная настройка «Ограничение минимального количества в заявке» на странице «Классы» (см. п. 7) проверяется совместно с данной настройкой из шаблона «по ограничениям». Настройки в шаблоне проверяются в первую очередь. Если ни одно из ограничений в шаблоне не нарушено, то проверяются глобальные ограничения. Ограничения устанавливаются для пары значений «Класс» + «Инструмент». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в данной настройке, то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в глобальной настройке (см. п. 7).
_ Классы	Список классов бумаг, для которых задается минимально допустимое количество лотов ЦБ в заявке клиента. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Количество	Минимальное количество лотов в заявке. Заявка с количеством лотов, меньше заданного, отвергается при проверке покупательной способности. Если для класса не указано значение в поле «Количество», то используется значение параметра «Минимальное кол-во» из Таблицы текущих торгов инструмента заявки. Если значение отсутствует и в Таблице текущих торгов, то ограничения нет
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение минимального количества в заявке действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение минимального количества в заявке. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Огр. объёма заяв. от об.»	
Ограничение на объем заявок в процентах от среднедневного оборота	Содержит список индивидуальных ограничений на объем заявок в процентах от среднедневного объема торгов для различных классов. Настройка распространяется на все рынки и классы, если они заданы в параметре «Класс ограничения». Среднедневной оборот рассчитывается сервером QUIK при старте на основе архивных данных. Ведение архива дневных

Параметр	Назначение
	объемов торгов обеспечивается Модулем ведения архивов. Его использование обязательно. Для работы настройки необходимо обеспечить наличие в архиве (Модуль ведения архивов) значения параметра «Оборот» (valtoday). При расчете среднедневного оборота дни с нулевым оборотом и дни, по которым отсутствуют архивные данные, не учитываются. Действие данной настройки распространяется также на заявки, закрывающие позицию. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в данной настройке, то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в глобальной настройке (см. п. 28).
_ Класс ограничения	Список классов, по которым задается ограничение. Обязательно к заполнению при указании данных в других столбцах
_ Ограничение, %	Процент, ограничивающий максимальный объем заявки от среднедневного оборота. Параметр обязателен для заполнения
_ Предупреждение, %	В настоящее время не используется
_ Класс оценки	Режим торгов, среднедневной объем по которому используется при расчете максимально возможного объема заявки. Если для оценки заявок в определенном режиме требуется использовать оборот в этом же режиме, то параметр не указывается. Для корректной работы настройки на сервер должны транслироваться описания инструментов по режиму торгов, соответствующему классу оценки
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на максимальный объем заявок действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на максимальный объем заявок. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты».
Вкладка «Д.О.: Огр. объёма заяв. от об.» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций. Набор параметров и их назначение аналогичны параметрам на вкладке «Огр. объема заяв. от об.». Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Запрет по контрагенту и валюте расчетов»	

Параметр	Назначение
Запрет операций с контрагентом по валюте расчетов	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций на фондовом и валютном рынках в указанных классах с учетом валюты расчетов и инструмента (задается в рамке «Инструменты»). Настройка учитывается только для адресных операций
_ Контрагент	Контрагент, с которым запрещено проведение операций
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, в котором действует запрет
Инструменты	Список инструментов
_ Все инструменты	Запрет на проведение операций действует на все инструменты
_ По списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует запрет на проведение операций. Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Вкладка «Д.О.: Запрет по контрагенту и валюте расчетов» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций. Набор параметров и их назначение аналогичны параметрам на вкладке «Запрет по контрагенту и валюте расчетов». Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Ограничение по контрагенту и сроку РЕПО»	
Ограничение операций РЕПО с контрагентом по сроку РЕПО	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций в зависимости от класса, валюты расчетов операции, валюты номинала инструмента и срока РЕПО. Настройка учитывается только для адресных операций РЕПО
_ Контрагент	Контрагент, с которым запрещено проведение операций
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Валюта номинала	Валюта номинала инструмента, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, в котором действует запрет
_ Максимальный срок РЕПО	Максимально допустимый срок РЕПО

Параметр	Назначение
Вкладка «Д.О.: Ограничение по контрагенту и сроку РЕПО» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций. Набор параметров и их назначение аналогичны параметрам на вкладке «Ограничение по контрагенту и сроку РЕПО». Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Ограничение по объему и валюте расчетов»	
Ограничение максимального объема заявки в валюте расчетов	Контроль максимально допустимого объема операции с учетом класса, валюты расчетов и направления операции. Не учитывается для операций на срочном рынке
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, для которого действует ограничение
_ Направление	Направление операции. Для операций РЕПО задается направление первой части. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа»; _ «Не задано»
_ Максимальный объем	Максимальный объем операции
Вкладка «Д.О.: Ограничение по объему и валюте расчетов» – настройка дополнительных ограничений на совершение клиентом торговых операций. Набор параметров и их назначение аналогичны параметрам на вкладке «Ограничение по объему и валюте расчетов». Описание принципа работы дополнительных ограничений см. в п. 31	
Вкладка «Ограничение операций» — настройка дополнительных ограничений на операции	
Ограничения по типу инструмента и дате расчетов	Запрет операций в зависимости от типа инструмента, направления, срока расчетов по операции. Используется только для схемы кредитования «Валютное лимитирование» (FX)
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Для обозначения всех классов укажите <ALL>. Обязательно для заполнения

Параметр	Назначение
_ Тип инструмента	Тип инструмента операции. Возможные значения: _ «NOTSPECIFIED» (по умолчанию) — не выбрано; _ «SPOT» — СПОТ; _ «FORWARD» — форвард; _ «SWAP»— валютный своп; _ «TIME_DEPOSIT» – депозит; _ «CERTIFICATE_OF_DEPOSIT» – депозит НСО (неснижаемый остаток); _ «PMSPOT» – СПОТ, металлическая пара; _ «NDF» — беспоставочный форвард; _ «FLEXFORWARD» — форвард с произвольной датой расчетов
_ Направление	Направление операции. Возможные значения: _ «Не задано» (по умолчанию) — любое направление; _ «Покупка»; _ «Продажа»
_ Срок	Срок расчетов. Значение по умолчанию: «0» — запрет операций с инструментами выбранного типа независимо от срока (полный запрет операций с данным типом)

* – для классов РЕПО с ЦК направление первой части РЕПО в зависимости от настроек шлюза и сервера не всегда совпадает с направлением, указанным в заявке.

** – настройка имеет больший приоритет по отношению к глобальной настройке на странице Ограничения на … / Доступные бумаги.

*** – настройка имеет больший приоритет по отношению к глобальной настройке на странице Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО.

Комментарий

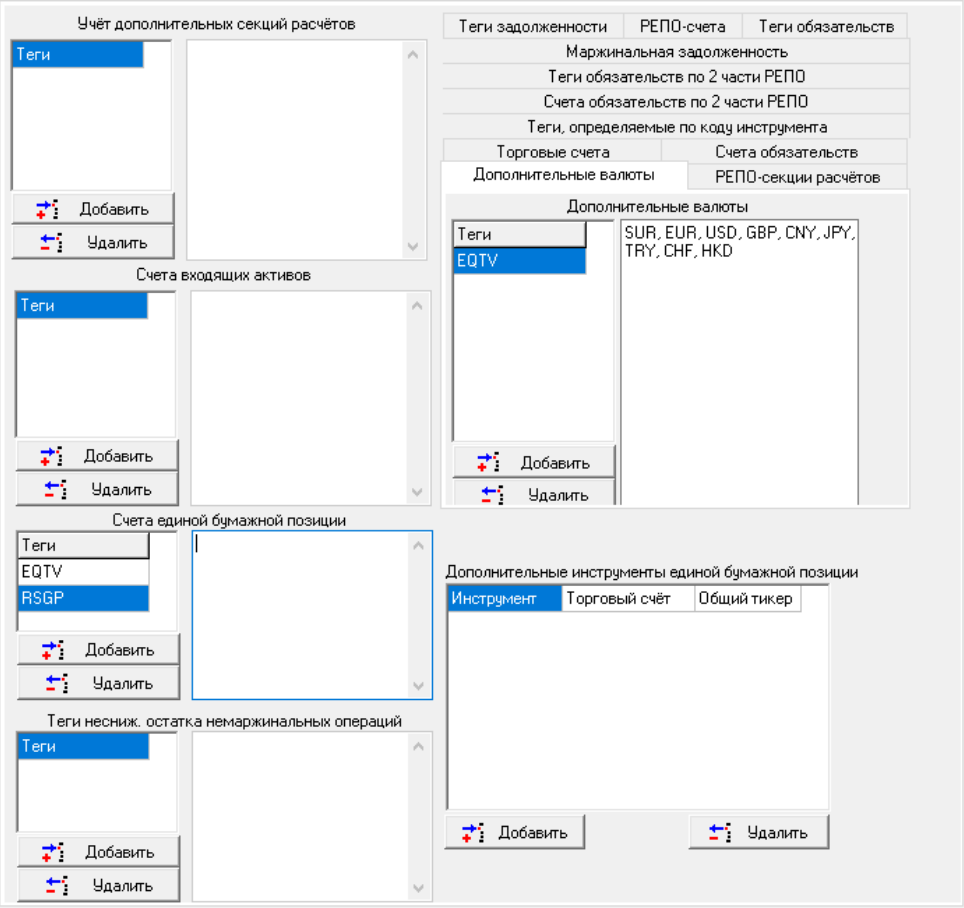
Приоритет выбора шаблона «По ограничениям»:

1. Настройки по шаблону, в котором значение поля «Включать в шаблон клиентов по значению плеча» совпадает со значением последнего заданного плеча на денежном лимите клиента (см. на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям», п. 16). Учитывается только для клиентов с типом кредитования «По дисконтам» или «МД+».
2. Настройки по шаблону для нескольких кодов клиентов, заданному на вкладке «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям» (см. п. 16).

Если ни одна из вышеперечисленных настроек для клиента не задана, то используются глобальные настройки.

17.Клиенты / Доп. теги расчетов

Настройки на данной странице позволяют учесть при вычислении лимитов клиентов средства на дополнительных счетах и тегах расчетов. Все настройки применяются для клиентов с типом кредитования «по плечу» и некоторые из них – для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+».



Параметр	Назначение
Учет дополнительных секций расчетов	Включение в расчет входящего и текущего лимитов позиций клиента, находящихся на дополнительных секциях расчета. Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» при расчете величины доступного для вывода остатка при включенной настройке «Выводить остаток с учетом доп. лимитов» (см. п. 4.3) учитываются средства на данном теге: сумма положительных и отрицательных денежных средств в основной валюте* минус заблокированные под вывод, комиссию и ЕДП средства. Величина остатка на данном теге не влияет на расчет стоимости портфеля и скорректированной маржи
_ Теги	Основной тег расчетов, например «EQTV»

Параметр	Назначение
_ Список тегов	Дополнительные теги расчетов через запятую, например «EQTA, BILL»
Счета входящих активов	Включение в расчет входящего и текущего лимитов позиций клиента, находящихся на дополнительных торговых счетах
_ Теги	Тег расчетов, например «EQTA»
_ Список счетов	Дополнительные торговые счета через запятую, например «S01-00000F00, Y01-00000F00»
Счета единой бумажной позиции	Настройка предназначена для суммирования позиций по инструментам (с учетом знака) с разных торговых счетов при расчёте покупательной способности. Для суммирования позиций родственных инструментов (торгующихся на разных торговых площадках и имеющих разные коды) требуется дополнительно настроить соответствие между ними в таблице «Дополнительные инструменты единой бумажной позиции». Используется для клиентов с типом кредитования «МП» («По плечу») и «МД+»
_ Теги	Тег расчетов, на котором обсчитывается операция, например, «EQTV»
_ Список счетов	Список торговых счетов через запятую. Допустимо использование префикса, например «L01*»
*** Теги неснижаемого остатка немаржинальных операций	Настройка позволяет задавать размер неснижаемого остатка на денежном лимите клиента, учитываемого при покупке немаржинальных бумаг либо при выводе денежных средств. Неснижаемый остаток задаётся в виде отрицательного значения поля «Входящий остаток» на дополнительных тегах расчетов, перечисленных в данной таблице. В строках столбца «Теги» указывается основной тег, в правом столбце – теги неснижаемого остатка через запятую. При проверке покупательной способности клиента размер доступных средств на совершение немаржинальных операций на основном теге расчетов уменьшается на сумму неснижаемых остатков с дополнительных тегов. При вычислении значения неснижаемого остатка суммируются только отрицательные значения полей «Входящий остаток» на перечисленных дополнительных тегах, нулевые и положительные значения не учитываются. Если настроена мультивалютная позиция, она учитывается при расчёте размера неснижаемого остатка. Настройка не влияет на покупательную способность клиента при маржинальных операциях.

Параметр	Назначение
	Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» отрицательный входящий остаток средств в основной валюте* уменьшает размер покупательной способности при покупке немаржинальных бумаг, выводе денежных средств, операциях срочного рынка и проверке претрейд-контроля при включении настроек «Ограничить покупку немаржинальных бумаг», «Ограничить вывод денежных средств», «Ограничить операции на срочном рынке» и «Ограничивать вывод денежных средств для претрейд-контроля», соответственно. Заблокированные средства в расчетах не учитываются. Величина остатка на данном теге не влияет на расчет стоимости портфеля и скорректированной маржи
Дополнительные инструменты единой бумажной позиции	Настройка является дополнением к таблице «Счета единой бумажной позиции» и предназначена для установления соответствия между кодами родственных инструментов
_ Инструмент	Код инструмента
_ Торговый счет	Один из дополнительных торговых счетов, указанных в таблице «Счета единой бумажной позиции». Использование префикса для указания торгового счета не допускается
_ Общий тикер	Код инструмента, используемый в качестве общего тикера. При маржинальных расчётах оценка суммарной позиции по инструментам, объединённым под общим тикером, производится по стоимости инструмента, код которого указан в качестве общего тикера. В качестве общего тикера не могут использоваться коды из колонки «Инструмент»
Вкладка «Теги, определяемые по коду инструмента»	
** Теги, определяемые по коду инструмента	Настройка соответствия тегов расчетов и кодов инструментов. Имеет более высокий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Другие параметры» в пункте «Теги расчётов для режимов торгов». Настройка применяется также для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+»
_ Теги	Список тегов
_ Список инструментов	Коды инструментов, разделенные запятыми, позиции по которым включаются в расчет входящего и текущего лимитов по заданному тегу расчетов, например, «LKOH, RTKM»
Вкладка «Дополнительные валюты»	
Дополнительные валюты	Включение в расчет входящего и текущего лимитов позиций клиента, заданных в разных валютах. Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» покупательная способность валют, перечисленных для тега, объединяется. При совершении операции, учитываемой по тегу,

Параметр	Назначение
	указанному в настройке, и по валюте, которая задана для такого тега, средства в перечисленных для тега валютах суммируются, то есть все такие валюты и оцениваемые в них активы объединяются в один портфель.
_ Теги	Список тегов
_ Список валют	Список валют через запятую, например, «SUR, USD, EUR»
Вкладка «РЕПО-секции расчетов»	
*** РЕПО-секции расчетов	Включение в расчет входящего и текущего лимитов и текущих активов позиций клиента, находящихся на дополнительных секциях расчета. Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» сумма положительных и отрицательных денежных средств в основной валюте* учитывается при расчете стоимости портфеля. Заблокированные под вывод, комиссию и ЕДП средства в основной валюте* учитываются при расчете скорректированной маржи. Величина остатка на данном теге влияет на расчет стоимости портфеля и скорректированной маржи. При расчете величины доступного для вывода остатка при включенной настройке «Выводить остаток с учетом доп. лимитов» (см. п. 4.3) учитываются средства на данном теге: сумма положительных и отрицательных денежных средств в основной валюте* минус заблокированные под вывод, комиссию и ЕДП средства. Для клиентов с типом кредитования «МД+» средства с указанных дополнительных тегов учитываются в портфеле следующим образом: _ Позиции с дополнительного тега учитываются в стоимости портфеля вне зависимости от знака; _ Блокировки по дополнительному тегу учитываются в скорректированной марже. Позиции на скорректированную маржу не влияют
_ Теги	Основной тег расчетов, например «EQTV»
_ Список тегов	Дополнительные теги расчетов через запятую, например «EQTA, BILL»
Вкладка «Теги задолженности»	
*** Теги задолженности	Включает в расчет входящего и текущего лимитов задолженность клиента – позиций клиента, находящихся на дополнительных секциях расчета. Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» и «МД+» отрицательный текущий остаток средств в основной валюте*

Параметр	Назначение
	в полном объеме учитывается при расчете скорректированной маржи. Заблокированные средства в расчетах не учитываются. Величина остатка на данном теге не влияет на расчет стоимости портфеля. Для клиентов с типом кредитования «по плечу» денежные средства с дополнительного тега, привязанного к тегу расчётов операции (тег, заданный для класса в параметре «Теги расчётов для режимов торгов»), увеличивают задолженность
_ Теги	Основной тег расчетов, например «EQTV»
_ Список тегов	Дополнительные теги расчетов через запятую, например «EQTA, EQTS, EQTT»
Вкладка «РЕПО-счета»	
РЕПО-счета	Включение в расчет входящего и текущего лимитов позиций клиента, находящихся на дополнительных торговых счетах. Позиции клиента на таких счетах не будут учитываться при расчете текущей позиции по инструменту
_ Теги	Основной тег расчетов, например «EQTV»
_ Список счетов	Дополнительные торговые счета через запятую. Допустимо использование префикса, например «L01*»
Вкладка «Теги обязательств»	
Теги обязательств	Включает в расчет покупательной способности клиента позиции, образовавшиеся на указанных тегах расчётов. В расчёт берутся только отрицательные значения денежных лимитов с указанных тегов (т.е. текущие обязательства клиента, превышающие его денежные остатки на перечисленных тегах), положительные значения не используются в дальнейших расчётах. Дальнейшие расчёты производятся аналогично учёту секций РЕПО. Чтобы данные теги не влияли на расчет уровня маржи, используйте признак «Не учитывать доп. обяз. при расчете ур. маржи» (см. п. 4.1). Настройка не поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Для клиентов с типом кредитования «МД+» средства с указанных дополнительных тегов учитываются в портфеле следующим образом: _ отрицательные позиции учитываются при расчете скорректированной маржи как поручения на вывод средств; _ при расчете стоимости портфеля, начальной и минимальной маржи позиции с дополнительных тегов не учитываются;

Параметр	Назначение
	_ положительный остаток и блокировки на дополнительном теге не учитываются; _ при учете средств с дополнительного тега учитывается настройка «Дополнительные валюты»: _ если настройка задана для основного и дополнительного тегов, и для обоих тегов указана валюта расчетов по операции, то отрицательный остаток на дополнительном теге учитывается по всем дополнительным валютам, которые указаны в настройке одновременно для основного и дополнительного тегов; _ иначе учитываются средства только в валюте расчетов по операции
_ Теги	Основной тег учета обязательств, например «EQTV»
_ Список тегов	Дополнительные теги расчетов через запятую, например «EQTS, EQTT»
Оценивать общую задолженность по рынку	Выбор способа оценки задолженности по рынку: _ «Выключено» – исходя из значений лимита только по денежным средствам с указанных тегов учета обязательств (значение по умолчанию); _ «Включено» – добавляет к значению денежного лимита на теге обязательств – оценку имеющихся у клиента бумаг, принимаемых в обеспечение и находящихся на торговых счетах, относящихся к этому тегу обязательств. Если полученная сумма отрицательна, это значение используется в качестве значения текущих обязательств клиента. Если сумма положительна, значение на этом теге обязательств не используется в дальнейших расчётах
Вкладка «Теги обязательств по 2 части РЕПО»	
Теги учета обязательств по второй части РЕПО	Настройка списка тегов для учета обязательств по вторым частям сделок РЕПО. Используется при включении опции «Пересчитывать ожидаемую позицию» (см. п. 4.3). Если настройка тегов отсутствует, то для вторых частей РЕПО будет применяться настройка «РЕПО-секции расчетов»
_ Теги	Тег расчетов
Теги учета дополнительных обязательств	Дополнительный тег учета обязательств по денежным средствам по сделкам РЕПО. Одному тегу расчетов может соответствовать только один тег учета дополнительных обязательств
Вкладка «Счета обязательств по 2 части РЕПО»	

Параметр	Назначение
Счета учета обязательств по вторым частям РЕПО	Настройка счетов для учета обязательств по вторым частям сделок РЕПО. Используется при включении опции «Пересчитывать ожидаемую позицию» (см. п. 4.3). Если настройка счетов отсутствует, то для вторых частей РЕПО будет применяться настройка «РЕПО-счета»
_ Теги	Тег расчетов
_ Счета учета обязательств	Торговый счет для учета обязательств по ценным бумагам, соответствующий указанному тегу. Одному тегу может соответствовать только один счет
Вкладка «Маржинальная задолженность»	
Учитывать маржинальную задолженность другого рынка	Учет маржинальной задолженности на другом рынке. Если на другом рынке образуется отрицательный доступный текущий лимит, то на его размер уменьшается текущий лимит на основном теге
_ Теги	Тег рынка, для которого прописывается дополнительная задолженность, максимум 4 символа. Например, «EQTV»
_ Описания другого рынка	Формат описания: «Тег, Валюта, Лимит», где: _ «Тег» – тег рынка маржинальной задолженности, не пустое значение, максимум 4 символа; _ «Валюта» – валюта лимита для учета плеча, не пустое значение, максимум 4 символа; _ «Лимит» – основной торговый счет рынка маржинальной задолженности, максимум 12 символов, может отсутствовать. Например, «GLSP, USD, GLSpot»
Вкладка «Торговые счета»	
Игнорировать торговые счета по тегам расчетов	Список торговых счетов, которые будут игнорироваться при вычислении покупательной способности по данному тегу расчетов. Данная запрещающая настройка имеет наивысший приоритет среди аналогичных настроек по счетам и тегам. Настройка применяется также для клиентов с типом кредитования «по дисконтам»
_ Теги	Тег расчетов. Ключи тегов вида <ALL> не поддерживаются
_ Торговые счета	Список игнорируемых торговых счетов, через запятую. Префиксы торгового счета не предусмотрены, следует указывать полные коды торговых счетов. Для заданного тега список счетов не должен быть пустым. Допускается соответствие одного торгового счета нескольким тегам расчетов
**** Вкладка «Счета обязательств»	

Параметр	Назначение
_ Теги	Тег расчетов, например «EQTV»
_ <Список торговых счетов>	Торговые счета (через запятую), которые используются для учета обязательств клиентов по ценным бумагам. Допустимо использование префикса с добавлением символа «*». Пример: «BQ1-00000F00, L01*». В данном случае при претрейд-проверке заявки, расчеты по которой производятся на указанном теге расчетов, обязательства клиентов будут учтены с торгового счёта BQ1-00000F00 и со всех торговых счетов, начинающихся с «L01». В качестве задолженности будет учтена сумма только отрицательных текущих остатков с перечисленных торговых счетов. Положительные текущие остатки и заблокированные средства на перечисленных торговых счетах в расчете не учитываются

*Основная валюта (здесь) – валюта, в которой выполняются блокировка и списание средств по операции.

(**) Комментарий к вкладке «Теги, определяемые по коду инструмента»:

Настройки привязки инструментов / классов к тегам расчетов имеют следующий приоритет:

1. Индивидуальная настройка для кода клиента «Теги, определяемые по коду инструмента», имеет максимальный приоритет. Настройка может быть задана по шаблону для нескольких кодов клиентов.
2. Глобальная настройка «Теги, определяемые по коду инструмента». Используется для кодов клиентов, у которых отсутствуют аналогичные индивидуальные настройки.
3. Индивидуальная настройка для кода клиента «Теги расчётов для режимов торгов» (привязка тега расчётов к классу инструментов). Настройка может быть задана по шаблону для нескольких кодов клиентов.
4. Глобальная настройка «Теги расчётов для режимов торгов» (привязка тега расчётов к классу инструментов). Используется для кодов клиентов, у которых отсутствуют аналогичные индивидуальные настройки.
5. Настройка по умолчанию. Используется, если в настройках Дилерской Библиотеки явным образом не сопоставлен тег расчётов ни инструменту, по которому производится операция, ни классу, в который данных инструмент входит. Например, для класса Московской Биржи «A1-Акции» в этом случае будет использоваться тег «EQTV». Нужно учитывать, что настройки по умолчанию существуют не для всех классов бумаг.

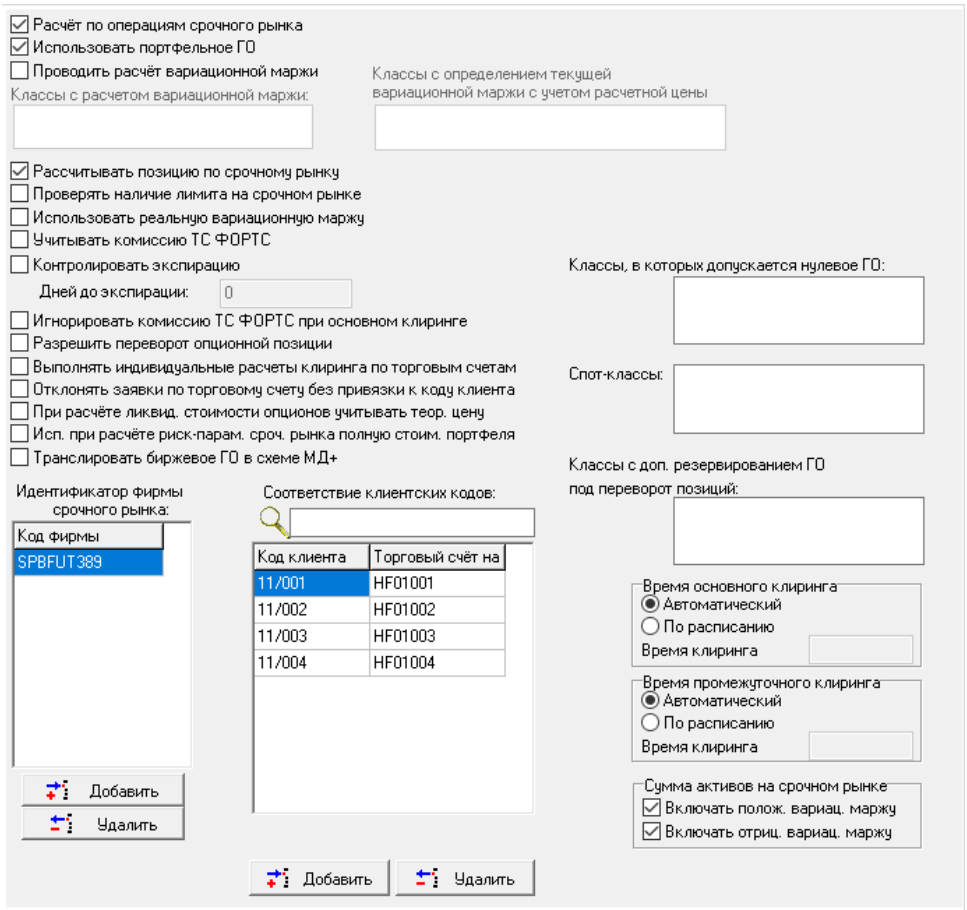
(***) В схеме «МД+» при учете средств с дополнительных тегов (настройки «РЕПО-секции расчетов», «Теги задолженности» и «Теги неснижаемого остатка немаржинальных операций») используется настройка «Дополнительные валюты» для основного и дополнительного тегов: учитываются средства в тех валютах, покупательная способность которых объединена для обоих тегов.

(****) Комментарий к вкладке «Счета обязательств»:

Особенности учета параметров для клиентов с типами кредитования «МД+» и «МП»:

1. Для клиентов с типом кредитования «МД+» наличие обязательств по инструменту учитывается только при проверке заявок на продажу для инструментов, по которым запрещено образование короткой позиции – проверяется, чтобы после исполнения заявки у клиента не образовалась непокрытая (короткая) позиция по инструменту. Если на дополнительных торговых счетах имеется задолженность, клиент не сможет полностью закрыть имеющуюся длинную позицию по инструменту, поэтому текущий остаток на его торговом счете заявки должен быть не меньше имеющейся задолженности. Запрет образования короткой позиции по инструменту определяется соответствующим немаржинальным эффективным дисконтом или запретом, установленным в настройках «Бумаги, запрещенные для открытия коротких позиций в заданном классе» или «Классы, в которых запрещено открывать короткие позиции по заданной бумаге» (см. п. 22.3).
2. Для клиентов с типом кредитования «МП» остаток на счете интерпретируется как задолженность по ценным бумагам и уменьшает уровень маржи клиента.

18.Учет операций срочного рынка



На этой странице выполняется настройка Единой денежной позиции для спот- и срочного рынков. Настройки имеют смысл при наличии на сервере соответствующего модуля.

Модуль осуществляет контроль единой денежной позиции клиента на фондовом и срочном рынках и снимает потребность в перераспределении средств вручную. Модуль позволяет объединить денежную позицию для клиента на рынке базового актива (спот-рынке) и рынке фьючерсов. При этом для работы используется одна фирма с возможностью указывать счета этой фирмы, как счета, работающие или не работающие с ЕДП. Клиенту выставляется единая позиция по денежным средствам для проведения операций на фондовом рынке и расчета гарантийного обеспечения на срочном рынке.

Настройка должна выполняться из Дилерской библиотеки, соответствующей идентификатору дилера на спот-рынке.

Произведенные изменения на данной странице вступают в силу после рестарта сервера QUIK (перезагрузки Библиотеки расчета лимитов недостаточно).

Параметр	Назначение
Расчёт по операциям срочного рынка	Включает связь между счетом срочного рынка со спот-кодом клиента
Использовать портфельное ГО	Включает расчет обеспечения под позиции и заявки клиента согласно модели портфельного гарантийного обеспечения. При выключенном флажке размер обеспечения транслируется из торговой системы (см. п. 1.1 Описания настроек ПГО)
Проводить расчет вариационной маржи	Включает расчет вариационной маржи по текущим позициям, а также вариационной маржи клиринга. Расчет проводится за день по позициям на начало дня и по всем сделкам клиента. При выключенном флажке вариационная маржа транслируется из торговой системы. Данная настройка используется совместно с настройками «Время основного клиринга» и/или «Время промежуточного клиринга»
_ Классы с расчетом вариационной маржи	Список классов через запятую, для которых действует настройка «Проводить расчет вариационной маржи». Если список не задан, то вариационная маржа рассчитывается по всем классам срочного рынка
_ Классы с определением текущей вариационной маржи с учетом расчетной цены	Список классов через запятую, для которых при расчете вариационной маржи сервером в первую очередь используется текущая расчетная цена, а не цена последней сделки
Рассчитывать позицию по срочному рынку	Включает ведение клиентской позиции и контроль операций по классам с флагами «Фьючерсы» или «Опционы» (подробнее см. Руководство по администрированию QUIK Administrator, п. 5.1.2)
Проверять наличие лимита на срочном рынке	Включает проверку на наличие денежного лимита, заданного на торговый счёт клиента в торговой системе срочного рынка. При отсутствии лимита, заявки клиента по срочному рынку отклоняются. При выключенном флажке, наличие денежного лимита на торговом счёте клиента в торговой системе срочного рынка при подаче заявки не контролируется
Использовать реальную вариационную маржу	Включает учет операций с использованием реальной вариационной маржи в ТС ФОРТС
Учитывать комиссию ТС ФОРТС	В настоящее время признак не используется
Контролировать экспирацию	Включает контроль срока, оставшегося до экспирации контрактов (опционов и фьючерсов)

Параметр	Назначение
_ Дней до экспирации	Активизируется при включении флажка «Контролировать экспирацию». Для контрактов, у которых срок до экспирации равен или меньше введённого значения, заявки на наращивание позиций будут отклонены сервером. Количество дней до исполнения включает в себя дату экспирации и текущую дату. Например, если в дату экспирации указано значение «1», то для контрактов с датой погашения в этот день наращивание позиции будет запрещено. Если указано значение «0», то контроль не осуществляется
Игнорировать комиссию ТС ФОРТС при основном клиринге	Отключает списание комиссии ТС ФОРТС с денежного лимита клиента, с единой денежной позицией во время основного клиринга
Разрешить переворот опционной позиции	Включает возможность обеспечения выставления заявок по опционам, исполнение которых приводит к перевороту позиции. По умолчанию возможность переворота опционной позиции отключена
Выполнять индивидуальные расчёты клиринга по торговым счетам	Настройка позволяет корректно осуществлять клиринг по счетам с единой денежной позицией в случае поступления клиринговых данных из торговой системы срочного рынка МБ с задержкой. При включенной настройке клиринговые расчёты проводятся в несколько итераций, по мере поступления клиринговых данных на сервер QUIK. На каждой итерации расчёты проводятся только для торговых счетов, для которых клиринговые данные уже поступили. Настройка используется, если ведение единой денежной позиции осуществляется ТОЛЬКО по счетам срочного рынка МБ. Если ведение единой денежной позиции осуществляется по счетам других срочных рынков, обратитесь в Службу технической поддержки QUIK для получения дальнейших рекомендаций: quiksupport@arqatech.com
Отклонять заявки по торговому счету без привязки к коду клиента	При совместном включении этой настройки и настройки «Расчёт по операциям срочного рынка» ограничивается подача заявок по торговым счетам, отсутствующим в списке «Соответствие клиентских кодов». Таким образом, при использовании Единой денежной позиции становится возможным разрешить подачу заявок на срочный рынок исключительно по торговым счетам, явно прописанным в списке «Соответствие клиентских кодов»
При расчёте ликвид. стоимости опционов учитывать теор. цену	При расчёте ликвидационной стоимости опционов учитывается теоретическая цена

Параметр	Назначение
Исп. при расчёте риск-парам. сроч. рынка полную стоим. портфеля	При расчёте риск-параметров срочного рынка используется полная стоимость портфеля, а не сумма активов на срочном рынке
Транслировать биржевое ГО в схеме МД+	Для клиентов с типом кредитования «МД+» и настроенной ЕДП транслировать следующие параметры в таблицу «Ограничения по клиентским счетам»: _ Текущие чистые позиции; _ Текущие чистые позиции (под заявки); _ Текущие чистые позиции (под открытые позиции)
Идентификатор фирмы срочного рынка	Идентификатор дилера на срочном рынке
_ Код фирмы	Код фирмы на срочном рынке. По умолчанию выбран основной раздел ФОРТС, который задается в файле настроек QAdminSrv.ini
Соответствие клиентских кодов	Таблица соответствий клиентских кодов. Максимальное количество отображаемых кодов – 50. В таблице доступен поиск значения по подстроке, вводимой в поле над таблицей.
_ *Код клиента	Код клиента на фондовом рынке
_ *Торговый счет на срочном рынке	Торговый счет клиента на срочном рынке
Классы, в которых допускается нулевое ГО	Список классов срочного рынка, в которых допускается нулевое ГО на инструментах. Учитывается только при отключенной настройке «Использовать портфельное ГО» (см. п. 18). Для классов из данного списка настройка «Проводить расчет вариационной маржи» (см. п. 18) должна быть выключена
Спот-классы	Список классов срочного рынка, к которым применяются правила лимитирования, используемые для классов фондового рынка
Классы с доп. резервированием ГО под переворот позиций	Список классов, для которых в случае выставления новой заявки, приводящей при полном исполнении к перевороту позиции, взимается дополнительное ГО в размере образующейся позиции противоположного направления
Время основного клиринга	Настройка режима проведения основного клиринга
_ Автоматический	Режим автоматического запуска основного клиринга по расписанию торговой системы

Параметр	Назначение
_ По расписанию	Режим запуска основного клиринга в момент времени, указанный в поле «Время клиринга»
_ Время клиринга	Время проведения основного клиринга в формате <ЧЧ:ММ>. Если сервер QUIK запущен позже указанного времени, то основной клиринг не проводится
Время промежуточного клиринга	Настройка режима проведения промежуточного клиринга
_ Автоматический	Режим автоматического запуска промежуточного клиринга по расписанию торговой системы
_ По расписанию	Режим запуска промежуточного клиринга в момент времени, указанный в поле «Время клиринга»
_ Время клиринга	Время проведения промежуточного клиринга в формате <ЧЧ:ММ>. Если сервер QUIK запущен позже указанного времени, то промежуточный клиринг не проводится
Сумма активов на срочном рынке	Настройка расчета суммы активов на срочном рынке
_ Включать полож. вариац. маржу	Учитывать положительную вариационную маржу при расчете суммы активов на срочном рынке
_ Включать отриц. вариац. маржу	Учитывать отрицательную вариационную маржу при расчете суммы активов на срочном рынке

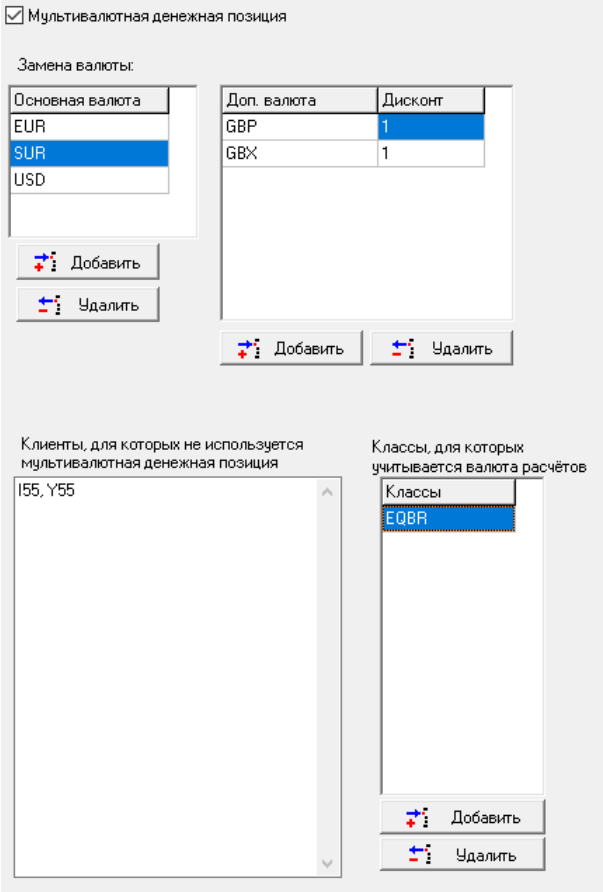
* – «Код клиента» и «Торговый счет на срочном рынке» могут оканчиваться символом «*». В этом случае они рассматриваются как префикс и определяют правило соответствия всех кодов, начинающихся с указанной строки символов торговым счетам на срочном рынке, начинающихся с указанной для них группы символов.

> **Для работы Модуля единой денежной позиции (ЕДП) в Библиотеке расчета лимитов имеется привязка тега и валюты денежного лимита (к EQTV и SUR), которая используется при расчете операций срочного рынка по умолчанию. Если при работе ЕДП требуется привязка к другому денежному лимиту, укажите в файле настроек deallib.ini следующие параметры:**

```
[PortfolioRiskConfig]
Currency= валюта денежного лимита
BoardTag= тег расчетов
```

19.Валюты денежных позиций

Страница «Валюты денежных позиций» предназначена для настройки схемы лимитирования, в которой операции по инструментам, номинированные в разных валютах, отображаются на одном денежном лимите (в одной выбранной валюте).

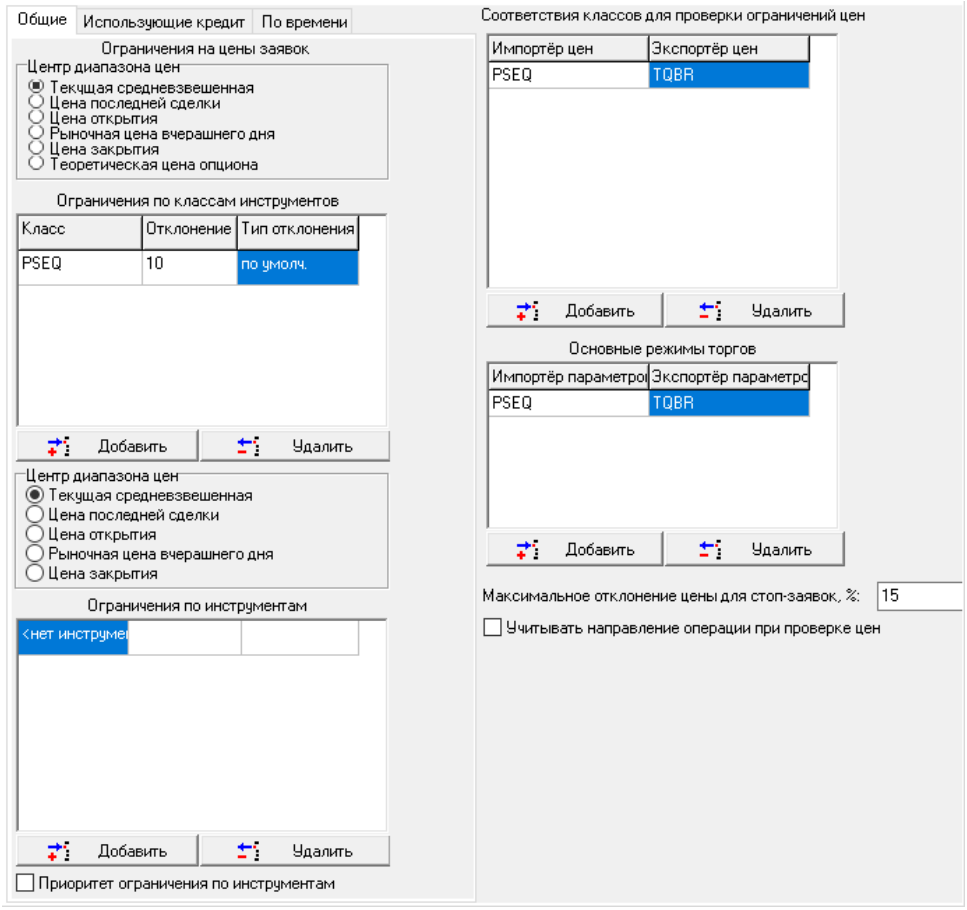


Раздел включает следующие элементы:

Параметр	Назначение
Мультивалютная денежная позиция	Установка флажка включает мультивалютную позицию и делает поля доступными для редактирования. При включенной настройке учёт операций, производимых в дополнительных валютах, происходит на денежном лимите клиента в основной валюте, с учётом конвертации валют по заданным на сервере кросс-курсам. При выключенной настройке сервис не предоставляется, даже если таблица с основными и дополнительными валютами заполнена. Данный функционал работает при совершении операций на фондовом рынке, а также на валютном рынке для инструментальной схемы лимитирования

Параметр	Назначение
Замена валюты	Настройка замены дополнительной валюты на основную с учетом курса конвертации
_ Основная валюта	Список основных валют лимитов, в которых на сервере QUIK ведутся лимиты клиентов
_ Доп. валюта	Список дополнительных валют, операции с участием которых будут учитываться на лимите по основной валюте. Список дополнительных валют настраивается отдельно для каждой основной валюты. Параметр обязателен для заполнения
_ Дисконт	Настройка не используется, рекомендованное значение: «1»
Клиенты, для которых не используется мультивалютная денежная позиция	Список кодов клиентов через запятую, для которых не применяются настройки мультивалютной денежной позиции. На параметры, указанные на странице «Клиенты/Доп. теги расчетов» (см. п. 17) данная настройка не распространяется
Классы, для которых учитывается валюта расчётов	Список классов РПС, для которых возможно выбрать валюту расчётов в форме ввода заявки. При этом шлюз к торговой системе должен поддерживать такие формы ввода заявок. По умолчанию, списание/зачисление средств производится в валюте номинала инструмента. Для классов, перечисленных в списке «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы», данная настройка игнорируется

20.Ограничения на ... / Цены заявок



Страница «Ограничения на…» не содержит информации и используется для группировки вложенных (подчиненных) страниц.

Страница «Ограничения на … / Цены заявок» предназначена для настройки допустимого диапазона цен заявок клиентов. Для некоторых классов (например, для сделок РПС) можно указывать цену для определения диапазона, используя информацию по инструментам из другого класса (например, А1-Акции).

Для настройки допустимых диапазонов цен заявок используются следующие вкладки: «Общие», «Использующие кредит», «По времени». Диапазоны цен, указанные на вкладке «Общие», проверяются всегда. Если в результате исполнения заявки клиент использует заемные средства, то дополнительно проверяются диапазоны цен с вкладки «Использующие кредит». Вкладка «По времени» предназначена для ограничения цен заявок на классах и инструментах в определенный период времени, а также для указания референсной цены, которая используется в целях проверки при отсутствии значений цен в торговой системе.

Для условных (стоп-) заявок проверка на попадание цены в диапазон допустимых цен осуществляется в момент срабатывания условия, а не в момент выставления заявки.

Параметр	Назначение
Вкладки «Общие», «Использующие кредит»	
Ограничения на цены заявок	Настройка допустимого отклонения от центра диапазона цен
Центр диапазона цен	Выбор параметра, относительно значения которого вычисляется диапазон отклонения допустимых цен заявок по умолчанию. Возможные значения: _ «Текущая средневзвешенная»; _ «Цена последней сделки»; _ «Цена открытия»; _ «Рыночная цена вчерашнего дня»; _ «Цена закрытия»; _ «Теоретическая цена опциона». Отклонение от теоретической цены опциона на вкладке «использующие кредит» работает только при использовании единой денежной позиции. Для операций РЕПО на отклонение проверяется цена первой части сделки. Для операций РЕПО с ЦК на отклонение проверяется ставка РЕПО, поэтому необходимо убедиться, что в качестве значения выбранного параметра торговой системой транслируется ставка РЕПО, а не цена. Если выбранный параметр не транслируется торговой системой, то используется параметр «Цена закрытия»
Ограничения по классам инструментов	Настройка допустимого отклонения от центра диапазона цен для разных классов бумаг
_ Класс	Идентификатор класса
_ Отклонение от цены, %	Величина допустимого отклонения, в процентах
_ Тип отклонения	Тип отклонения цены. Значение «По умолчанию» указывает на то, что отклонение по данному классу рассчитывается относительно параметра, выбранного в «Центре диапазона цен», но для каждого класса в отдельности этой настройкой можно задать собственный центр диапазона

Параметр	Назначение
Центр диапазона цен	Выбор параметра, относительно значения которого вычисляется диапазон отклонения допустимых цен заявок по умолчанию. Возможные значения: _ «Текущая средневзвешенная»; _ «Цена последней сделки»; _ «Цена открытия»; _ «Рыночная цена вчерашнего дня»; _ «Цена закрытия». Для операций РЕПО на отклонение проверяется цена первой части сделки. Для операций РЕПО с ЦК на отклонение проверяется ставка РЕПО, поэтому необходимо убедиться, что в качестве значения выбранного параметра торговой системой транслируется ставка РЕПО, а не цена. Если выбранный параметр не транслируется торговой системой, то используется параметр «Цена закрытия»
Ограничения по инструментам	Настройка допустимого отклонения от центра диапазона цен для разных инструментов
_ Инструмент	Идентификатор инструмента
_ Отклонение от цены, %	Величина допустимого отклонения, в процентах
_ Тип отклонения	Тип отклонения цены. Значение «По умолчанию» указывает на то, что отклонение по данному инструменту рассчитывается относительно параметра, выбранного в «Центре диапазона цен», но для каждого инструмента в отдельности этой настройкой можно задать собственный центр диапазона
Приоритет ограничения по инструментам	При установленном флажке проверяется только ограничение на инструмент. Ограничение на класс, к которому принадлежит инструмент, игнорируется. Если же флажок не выставлен, то проверяются оба ограничения (в результате, используется значение с меньшим диапазоном)
Вкладка «По времени»	
Референсная цена	Настройка позволяет задавать значение цены в некоторой валюте, которое будет использовано для контроля отклонения цены заявки, в случае отсутствия значений выбранного центра диапазона цен и цены закрытия по инструменту заявки
_ Инструмент	Идентификатор инструмента. Для одного инструмента может быть задана только одна цена
_ Цена	Значение цены. Для облигаций цена задается в процентах, для срочных контрактов – в пунктах. Параметр обязателен для заполнения

Параметр	Назначение
_ Валюта	Код валюты цены. Значение по умолчанию: _ для акций – валюта расчетов по проверяемой заявке; _ для облигаций – отсутствует; _ для срочных контрактов – валюта шага цены. Параметр не обязателен для заполнения
Ограничение на цены заявок по времени	Настройка позволяет задать максимально допустимое отклонение цены заявки от центра диапазона цен в разрезе классов, инструментов, а также в зависимости от времени. При использовании в качестве центра диапазона лучших цен спроса и предложения нижняя граница диапазона вычисляется на основании лучшей ценой спроса, верхняя – лучшей цены предложения. Если значение центра диапазона цен для инструмента и класса заявки отсутствует или равно нулю (т.е. не может быть определено), то в целях проверки используется цена закрытия по инструменту и классу заявки. Если в качестве центра диапазона используются лучшие цены спроса и предложения, то цена закрытия используется при отсутствии как одной из цен, так и обеих одновременно. Исключение составляют случаи, когда отсутствует только одна из цен спроса или предложения, а цена закрытия не позволяет корректно определить допустимый интервал (цена закрытия меньше лучшей цены спроса при отсутствии цены предложения или цена закрытия больше лучшей цены предложения при отсутствии цены спроса); в такой ситуации цена закрытия не используется, считается, что она отсутствует. Если цена закрытия отсутствует или равна нулю, то в качестве центра диапазона используется значение референсной цены, заданной для инструмента в настройке «Референсная цена». При этом значения референсной цены и цены заявки в случае необходимости приводятся к одной валюте с использованием текущего кросс-курса Сервера QUIK для соответствующих валют. Если в качестве центра диапазона используются лучшие цены спроса и предложения, то референсная цена используется при отсутствии как одной из цен, так и обеих одновременно. Исключение составляют случаи, когда референсная цена не позволяет корректно определить допустимый интервал при отсутствии только одной из цен спроса или предложения (референсная цена меньше лучшей цены спроса при отсутствии цены предложения или референсная цена больше лучшей цены предложения при отсутствии цены спроса); в такой ситуации референсная цена не используется, считается, что она отсутствует. Если используется настройка «Соответствия классов для проверки ограничений цен» и для класса заявки задан один или несколько классов-экспортёров, то используется подходящее значение центра диапазона по классу-экспортеру, а не по классу заявки.

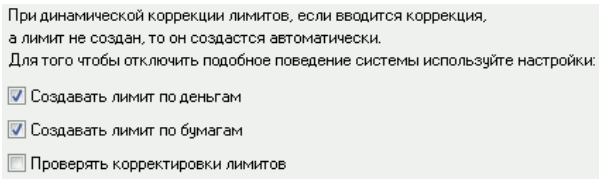
Параметр		Назначение
		Если для фьючерса задана настройка «Ограничение цены фьючерса для расчета риска» (см. п. 23) и текущий центр диапазона по модулю меньше, чем значение, заданное в настройке, то ограничение цены проверяется относительно текущего центра диапазона, а сам диапазон допустимых значений определяется исходя из значения ограничительной цены. То есть диапазон определяется следующим образом: [Центр диапазона – Ограничительная цена * Отклонение; Центр диапазона + Ограничительная цена * Отклонение]. Ограничения устанавливаются для параметров и их сочетаний: «Класс», «Класс» + «Инструмент», «Класс» + «Период», «Класс» + «Инструмент» + «Период». При этом значение <ALL> для классов и «Все инструменты» для инструментов учитываются как отдельные значения. Если ограничение для конкретного сочетания параметров «Класс», «Инструмент» и «Период» задано в настройке из шаблона (см. п. 16), то оно отменяет ограничение, заданное на такое же сочетание параметров в данной настройке.
_	Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_	Отклонение	Максимально допустимое отклонение цены заявки от центра диапазона цен в процентах. Параметр не обязателен для заполнения. Отсутствие значения параметра означает отсутствие ограничения
_	Центр диапазона цен	Выбор параметра, относительно значения которого вычисляется диапазон допустимого отклонения цен заявок. Возможные значения: _ «ср.-взвеш.» – текущая средневзвешенная цена; _ «последняя» (по умолчанию) – цена последней сделки; _ «открытия» – цена открытия; _ «рыночная» – рыночная цена вчерашнего дня; _ «закрытия» – цена закрытия; _ «теор. цена» – теоретическая цена опциона; _ «спрос/предл.» – лучшие цены спроса и предложения. Для операций РЕПО на отклонение проверяется цена первой части сделки. Для операций РЕПО с ЦК на отклонение проверяется ставка РЕПО, поэтому необходимо убедиться, что в качестве значения выбранного параметра торговой системой транслируется ставка РЕПО, а не цена. Если выбранный параметр не транслируется торговой системой, то используется параметр «Цена закрытия»
_	Отклонять заявку	Действие при отсутствии центра диапазона: _ «Да» – отклонять заявку; _ «Нет» (по умолчанию) – считать проверку успешной
_	Инструменты	Список инструментов указанного класса

Параметр	Назначение
_ все инструменты	Ограничение цены заявки действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение цены заявки. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
_ Начало периода	Время начала периода, в течение которого действует ограничение цены заявки, в формате <ЧЧ:ММ>. Значение по умолчанию: «00:00». Поле необязательно для заполнения
_ Конец периода	Время окончания периода, в течение которого действует ограничение цены заявки, в формате <ЧЧ:ММ>. Указанное значение может быть меньше, чем значение, заданное в поле «Начало периода». Значение по умолчанию: «23:59». Поле необязательно для заполнения
Соответствия классов для проверки ограничений цен	Установка соответствий классов для проверки ограничений цен для инструментов в смежных классах, например – «А1-Акции» и «РПС: А1-Акции»
_ Импортёр цен	Код класса, для инструментов которого выполняется проверка на отклонение цены
_ Экспортёр цен	Коды классов через запятую, среди цен инструментов которых ищется цена для использования в качестве центра диапазона
Основные режимы торгов	Настройка предназначена для перевода в лоты количества в сделках по классам с лотностью 1. Такая необходимость может возникнуть, если включена опция «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3), и лимиты по бумагам ведутся в лотах, размером больше 1. При учёте сделок из класса-импортёра на лимитах по бумагам, количество в сделке будет нормировано на размер лота из класса-экспортёра
_ Импортёр параметров	Класс, в котором размер лота равен 1. Количество в сделках по инструменту из этого класса, при учёте на лимите по бумагам, будет разделено на размер лота этого же инструмента в классе-экспортёре параметров. Дробная часть результата деления отбрасывается, поэтому важно учитывать, при совершении сделок по классу-импортёру параметров, чтобы количество в каждой сделке было кратным размеру лота в классе-экспортёре параметров
_ Экспортёр параметров	Класс, размер лота в котором совпадает с размером лота лимита по бумагам
Максимальное отклонение цены для стоп-заявок, %	Максимально допустимое отклонение цены стоп-заявки от цены последней сделки по инструменту, в процентах

Параметр	Назначение
Учитывать направление операции при проверке цен	При установленном флажке ограничения на цены заявок проверяются с учетом направления операции, то есть запрещается выставление заявок на покупку с отклонением цены в большую сторону и заявок на продажу с отклонением цены в меньшую сторону относительно заданного ограничения
Не использ. цену закрытия при отсутствии центра диапазона	При установленном флажке отклонение цены заявки не проверяется относительно цены закрытия при отсутствии значения выбранного центра диапазона

21.Ограничения на ... / Корректировка лимитов

На этой странице выполняется настройка действий сервера при динамической корректировке лимитов.

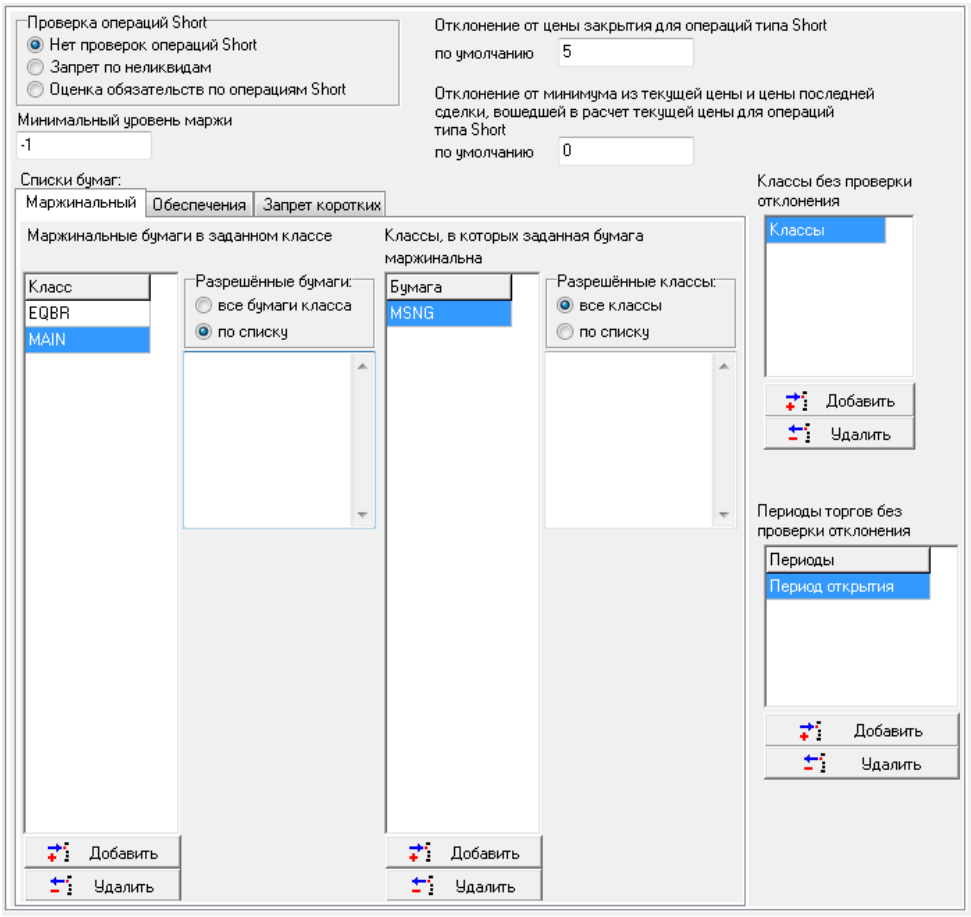


По умолчанию, при получении новой корректировки по коду клиента, на которого не определены лимиты, сервер создает их автоматически. Данные параметры позволяют управлять этим процессом.

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Создавать лимит по деньгам	При включенном флажке лимит по денежным средствам в приведенной выше ситуации будет создан. При отключенном флажке лимит не создается	Включен
Создавать лимит по бумагам	При включенном флажке лимит по бумагам в приведенной выше ситуации будет создан. При отключенном флажке лимит не создается	Включен
Проверять корректировки лимитов	При включенном флажке при получении корректировки выполняется проверка, приведет ли корректировка к нарушению минимального уровня маржи (см. п. 4.3). В случае нарушения корректировка игнорируется. При отключенном флажке проверка не выполняется	Выключен

22.Ограничения на ... / Использование «плеча»

На этой странице задаются глобальные настройки по умолчанию для маржинальных операций.



Параметр	Назначение
Проверка операций Short	Способ проверки операций «Short» для клиентов с типом кредитования «По лимитам». Для возможности использования этой настройки нужно сначала сформировать список бумаг на вкладке «Маржинальный»
_ Нет проверок операций Short	Проверки не используются
_ Запрет по неликвидам	Запрет заявок по немаржинальным бумагам, при наличии короткой позиции хотя бы по одному инструменту. Доступно только при отключенной опции «Общий лимит по деньгам и бумагам» в разделе «Общие настройки библиотеки. Часть 2»

Параметр	Назначение
_ Оценка обязательств по операциям Short	Размер доступных денежных средств для покупки немаржинальных бумаг рассчитывается как «Текущий остаток» минус сумма, необходимая для закрытия короткой позиции по цене продажи. Доступно только при отключенной опции «Общий лимит по деньгам и бумагам» в разделе «Общие настройки библиотеки. Часть 2»
Минимальный уровень маржи	Значение минимально допустимого уровня маржи, контролируемое при динамической корректировке лимитов. По действию идентичен аналогичному параметру на странице «Общие параметры», вкладка «Часть 3»
*Отклонение от цены закрытия для операций типа Short по умолчанию	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от цены закрытия предыдущей торговой сессии, когда цена заявки меньше цены закрытия предыдущей торговой сессии. Отклонение указывается в процентах и должно иметь строго положительное значение. Любое иное значение настройки эквивалентно её отсутствию и означает отсутствие проверок отклонений цен для операций «Short» вообще, для всех клиентов независимо от наличия у них индивидуальных настроек
*Отклонение от минимума из текущей цены и цены последней сделки, вошедшей в расчет текущей цены для операций типа Short по умолчанию	Допустимое отклонение цены заявки при операциях «Short» от наименьшей из двух цен: _ официальной текущей цены, сообщаемой торговой системой биржи; _ цены последней сделки, вошедшей в расчет текущей цены. Отклонение указывается в процентах. Если значение отрицательно, проверка этого условия не выполняется. Действие данной настройки распространяется только на рыночные заявки
Классы без проверки отклонения	Список классов, по которым не будет осуществляться проверка ограничений на цены в заявках на открытие коротких позиций. Редактирование списка классов доступно, если указано значение в поле «Отклонение от цены закрытия для операций типа Short». Опция распространяется на всех клиентов. В настройках на странице «Клиенты» / «Настройки плеча» и в настройках на странице «Клиенты» / «Шаблоны» / «По плечу» этот список невозможно изменить или игнорировать

Параметр	Назначение
Периоды торгов без проверки отклонения	Список статусов торговой сессии, в течение которых отменяется действие настроек «Отклонение от цены закрытия для операций типа Short» и «Отклонение от минимума из текущей цены и цены последней сделки, вошедшей в расчет текущей цены для операций типа Short». Возможные значения: _ «Открыта»; _ «Период открытия»; _ «Период закрытия»; _ «Аукцион закрытия»; _ «Период заявок по цене А3»

* – для условных (стоп-) заявок проверка отклонения осуществляется в момент срабатывания условия, а не в момент выставления стоп-заявки.

22.1 «Маржинальный» список

Список «Маржинальные бумаги в заданном классе»

Список бумаг указанного класса, разрешенных для сделок с использованием маржинальных средств, устанавливаемый по умолчанию для всех клиентов, не имеющих индивидуальных настроек. Этот и два последующих списка настраиваются по следующему правилу:

- В список классов добавляется новый класс;
- В правом окне через запятую указывается список используемых бумаг класса, либо выбирается значение «Все бумаги класса».

Также возможна индивидуальная настройка списка маржинальных бумаг для отдельных клиентов, которая выполняется на странице «Клиенты / Настройки «плеча»».

Список «Классы, в которых заданная бумага маржинальна»

Список бумаг, разрешенных для сделок с использованием маржинальных средств. По каждой бумаге указывается перечень классов, для которых установлена данная настройка. Список бумаг устанавливается по умолчанию для всех клиентов, не имеющих индивидуальных настроек. Настраивается по следующему правилу:

- В список бумаг добавляется новая бумага;
- В правом окне через запятую указывается список классов, использующих данную бумагу, либо выбирается значение «Все классы».

Также возможна индивидуальная настройка списка классов для отдельных клиентов, которая выполняется на странице «Клиенты / Настройки «плеча»».

Настройка «Маржинальные бумаги в заданном классе» имеет более высокий приоритет, чем настройка «Классы, в которых заданная бумага маржинальна».

Комментарии к настройкам списков «Маржинальные бумаги в заданном классе» и «Классы, в которых заданная бумага маржинальна» приведены в п. 32.

22.2 Список «Обеспечения»

Глобальная настройка списка инструментов, используемых в качестве обеспечения при оценке стоимости активов, и/или списка классов, использующих выбранный инструмент при оценке стоимости активов. Действует для клиентов, не имеющих индивидуальной настройки этого списка.

Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+» инструменты из списка «Обеспечения» учитываются настройкой «Запрет маржинальных покупок» (см. п. 23). Настраивается по тем же правилам, что и предыдущий список.

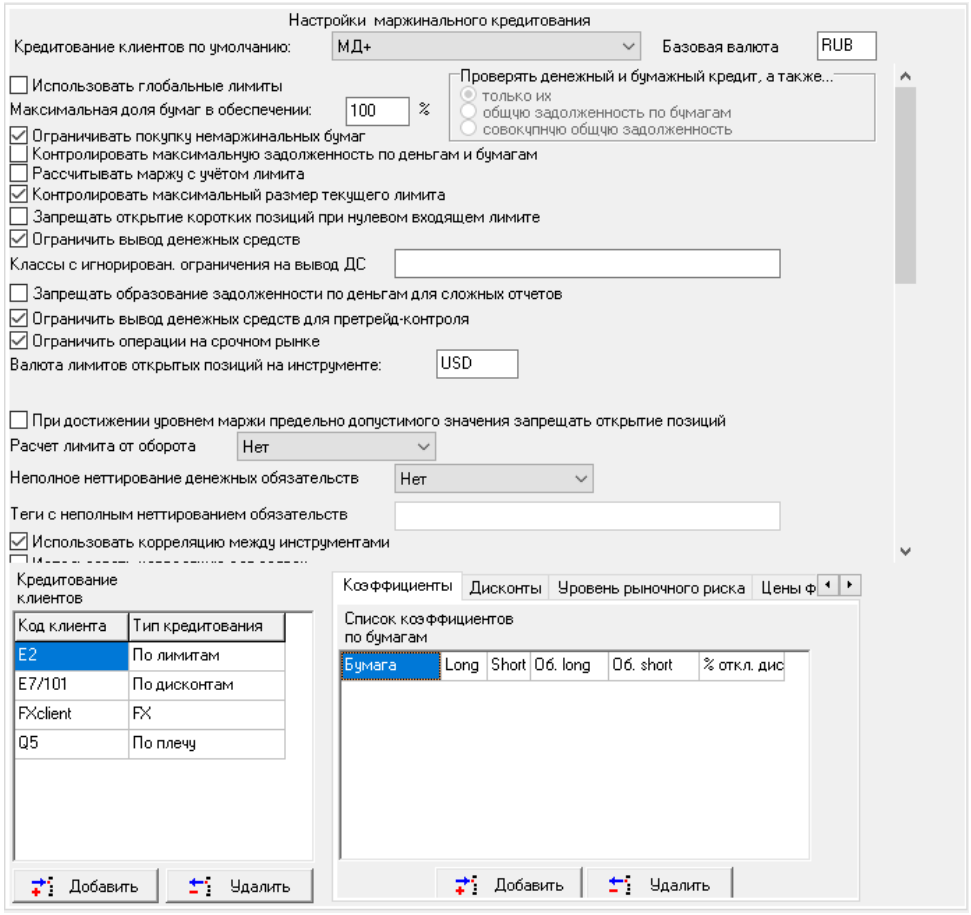
22.3 Список «Запрет коротких»

Настройка по умолчанию списка инструментов, по которым запрещено создавать короткие позиции, и/или списка классов, в которых установлен запрет коротких позиций по выбранному инструменту. Действует для клиентов, не имеющих индивидуальной настройки этого списка. Правила настройки те же.

Параметр	Назначение
Бумаги, запрещенные для открытия коротких позиций в заданном классе	Настройка списка инструментов, по которым запрещено создание коротких позиций
_ Класс	Выбор класса инструментов, по которому запрещено создание коротких позиций
_ Запрещенные бумаги	Настройка списка инструментов из выбранного класса, на которые распространяется запрет
_ Все бумаги класса	На все инструменты класса
_ По списку	На инструменты из списка внизу. Коды инструментов указываются через запятую
Классы, в которых запрещено открывать короткие позиции по заданной бумаге	Настройка списка классов, по которым запрещено создание коротких позиций
_ Инструменты	Выбор инструмента, по которому запрещено создание коротких позиций
_ Запрещенные классы	Настройка списка классов, на которые распространяется запрет
_ Все классы	На все классы
_ По списку	На классы из списка внизу. Коды классов указываются через запятую

23.Ограничения на … / Настройки маржинального кредитования

На этой странице задаются основные настройки маржинального кредитования.



Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Кредитование клиентов по умолчанию	Выбор схемы маржинального кредитования клиентов. Возможные значения: _ «По лимитам» («МЛ») – схема с указанием абсолютного размера лимитов; _ «По плечу» («МП») – схема с указанием кредитного «плеча»; _ «Лимит на открытую позицию» – схема с лимитированием стоимости открытой позиции;	По плечу

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	_ «По дисконтам» («МД») – схема с ограничением покупательной способности при помощи дисконтов по бумагам и валютам; _ «МД+» – схема с ограничением покупательной способности при помощи дисконтов по бумагам, валютам и фьючерсам с возможностью неттинга рисков по множествам инструментов; _ «FX» *** — схема кредитования «Валютное лимитирование», в рамках которой покупательная способность контролируется ограничением максимального размера коротких позиций. В течение торговой сессии НЕ РЕКОМЕНДУЕТСЯ изменять тип кредитования клиента во избежание некорректного вычисления лимитов. В случае необходимости изменения типа кредитования до окончания торгов требуется отозвать все активные поручения клиента всех типов и заново назначить лимиты	
_ Базовая валюта	_ В схеме «МД+» – валюта, используемая при расчете маржинальных показателей. Относительно валюты определяется необходимость учета валютного риска. _ В схеме «FX» – валюта, в которой задается ограничение на суммарную величину коротких позиций	«RUB»
Использовать глобальные лимиты	Возможность использования всех глобальных лимитов (глобальный лимит фирмы, глобальный лимит субброкера, информационный глобальный лимит, глобальный лимит на группу счетов по префиксу). Глобальные лимиты используются в схемах маржинального	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	кредитования «По дисконтам», «МД+» и «По плечу»	
Проверять денежный и бумажный кредит, а также	Настройка служит для установки контроля за кредитными ресурсами брокера. Переключателем можно выбрать одну из трех возможностей. Настройка доступна, если установлен флажок «Использовать глобальные лимиты»	
_ Только их	Отслеживает только значения общих денежного и бумажного кредитов	Включен
_ Общую задолженность по бумагам	Помимо ограничения размеров общих денежного и бумажного кредита, отдельно контролируется общий объём коротких позиций (в денежном выражении), который задаётся в поле «Входящий лимит» при установлении глобального лимита	Выключен
_ Совокупную общую задолженность	Помимо ограничения размеров общих денежного и бумажного кредита, отдельно контролируется общий объём кредитования всех клиентов (в денежном выражении), который задаётся в поле «Входящий лимит» при установлении глобального лимита. В общем объёме кредитования учитываются кредитные средства, использованные всеми клиентами в совокупности для открытия как маржинальных длинных, так и коротких позиций	Выключен
Максимальная доля бумаг в обеспечении, %	Максимальная доля позиции по одному инструменту, принимаемая в обеспечение. Если позиция клиента по какому-либо инструменту превышает указанную долю в совокупной стоимости обеспечения по всем бумажным активам, то в обеспечение принимается размер позиции по инструменту, равный максимальной доле, умноженной на совокупную стоимость обеспечения. Параметр может принимать значения в диапазоне от 50 до 100. Положительные значение менее 50 интерпретируются как значение «50», все остальные значения вне указанного диапазона интерпретируются как значение	100

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	«100». По умолчанию значение параметра также равно 100. Например, клиент имеет портфель из бумаг А (оценка 1000 р) и В (оценка 200р). Максимальная доля = 60%. Суммарное обеспечение равно 1200р. Бумага А вносит в обеспечение более 60%, поэтому ее вклад в обеспечение при расчете кредитного лимита при обработке заявки ограничивается величиной 60%. Т.е. обеспечение по бумаге А ограничивается величиной 720р	
Ограничивать покупку немаржинальных бумаг	Использовать ограничение на покупку немаржинальных бумаг в пределах остатка собственных средств, оставшихся свободными после покупки маржинальных бумаг: _ Если флажок включен, сервер QUIK будет отклонять заявки на покупку немаржинальных бумаг, которые не входят в обеспечение, если объем заявки будет превышать текущий остаток собственных денежных средств клиента по тегу и валюте текущей операции. _ Если флажок отключен, то сервер QUIK будет пропускать заявки на покупку немаржинальных бумаг, которые не входят в обеспечение, до исчерпания доступного лимита кредитования. Если клиент уже имеет отрицательный остаток по деньгам, то предполагается, что первоначальные покупки маржинальных бумаг клиент совершал не на собственные, а на заемные средства и теперь (даже когда у него текущий остаток по деньгам стал отрицательным) у него осталась часть собственных денежных средств для осуществления немаржинальных покупок. Поэтому при наличии отрицательного текущего остатка в таблице	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	«Купить/Продать» могут рассчитываться ненулевые значения в графе «На покупку» для немаржинальных бумаг, и клиент сможет купить немаржинальную бумагу. Подробнее см. комментарий к данной настройке	
Контролировать максимальную задолженность по деньгам и бумагам	Настройка позволяет ограничить максимально допустимую величину используемого кредита по деньгам, и отдельно по каждой бумаге. Значение максимально допустимого кредита ограничивается значением входящего лимита (по деньгам и по каждой бумаге, соответственно). Если по бумаге задано несколько лимитов на нескольких торговых счетах, для клиентов типа «МП» значение максимально допустимого кредита по бумагам ограничивается суммой значений «Входящий лимит» со всех торговых счетов, входящих в таблицу «Счета единой бумажной позиции». Максимальный размер кредита по деньгам можно задавать только для клиентов типа «МЛ». Максимальный размер кредита по бумагам можно задавать для клиентов «МЛ», «МП», «МД», а также для клиентов с типом лимитирования «Лимит на открытую позицию». Если в качестве значения «Входящего лимита» для актива установлен «0» – ограничение на кредитование по этому активу не проверяется. Для контроля максимального размера заемных средств для клиентов «МП», необходимо включить опцию «Контролировать максимальный размер текущего лимита» (описание приведено ниже)	Выключен
Рассчитывать маржу с учетом лимита	Настройка позволяет корректно рассчитывать маржу на клиентском терминале в случае использования нескольких денежных позиций. Перед	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	использованием этой опции проконсультируйтесь с разработчиком	
Контролировать максимальный размер текущего лимита	Настройка позволяет контролировать максимальный размер заемных средств для клиентов с типом кредитования «МП» («По плечу»). Максимальный размер кредита ограничивается значением входящего лимита по деньгам. Если он равен 0, то размер кредитных средств дополнительно не ограничивается. При включении опции максимальный объём кредитных ресурсов, рассчитываемый для клиента исходя из установленного размера плеча, ограничивается сверху значением, указанным в поле «Входящий лимит». В таком случае лимит клиенту следует загружать за два шага (при загрузке лимитов через файл – две последовательно идущие строки): _ на первом шаге загружается входящий остаток и входящий лимит; _ В рабочем месте QUIK это можно сделать из контекстного меню таблицы «Лимиты по денежным средствам». При загрузке лимитов через файл, на первом шаге в строке с денежным лимитом не указывается значение плеча; _ на втором шаге корректируются входящий лимит и размер плеча; _ В рабочем месте QUIK это можно сделать из контекстного меню таблицы «Клиентский портфель». При загрузке лимитов через файл, на втором шаге в строке с денежным лимитом не указывается значение входящего лимита	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Запрещать открытие коротких позиций при нулевом входящем лимите	Запрет заявок, приводящих к образованию коротких позиций по бумагам, для которых задано нулевое значение в поле «Входящий лимит». Настройка доступна только при включении опций «Контролировать максимальную задолженность по деньгам и бумагам» и/или «Контролировать максимальный размер текущего лимита»	Выключен
Ограничить вывод денежных средств	При включенном флажке клиент может вывести только остаток денежных средств – вывод средств ограничивается денежным лимитом с тегом расчетов и валютой, соответствующими операции ввода/вывода средств, а также тегом неснижаемого остатка (см. п. 17). При выключенном флажке могут быть выведены средства в размере, превышающем собственный остаток в пределах свободных средств маржинального портфеля. Например, в схеме «по плечу»: если клиент, имея плечо 1 и 100 рублей на счете, сделает покупку на 90 рублей, то при включенном флажке ему дадут вывести только 10 рублей, а при выключенном – 55 рублей. Настройка позволяет контролировать образование непокрытых позиций на промежуточных видах лимитов, в том числе для вывода средств. Настройка является глобальной и имеет более низкий приоритет по отношению к индивидуальным настройкам и настройкам клиентов по шаблону. Действие настройки распространяется на сложные отчеты, если включена настройка «Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов». Действие настройки не распространяется на классы, указанные в параметре «Классы с игнорирован. ограничения на вывод ДС»	Включен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
_ Классы с игнорирован. ограничения на вывод ДС	Список классов, для которых отменяется действие настройки «Ограничить вывод денежных средств»	
Запрещать образование задолженности по деньгам для сложных отчетов	Запрет образования или увеличения задолженности по денежным средствам в результате исполнения сложного отчета. Используется, если настройка «Ограничить вывод денежных средств» включена	Включен
Ограничить вывод денежных средств для претрейд-контроля	Функциональность данной настройки аналогична настройке «Ограничивать вывод денежных средств», но распространяется только на совершение торговых операций через Модуль пре-трейд контроля	Включен
Ограничить операции на срочном рынке	Настройка позволяет выбирать возможность торговли срочными инструментами в единой денежной позиции либо за счет только остатка собственных средств, либо за счет привлечения дополнительно заемных средств, вплоть до ограничительного уровня маржи. См. Комментарий к данной настройке	Включен
Валюта лимитов открытых позиций на инструменте	Валюта, в которой указываются ограничения на открытые позиции по бумагам. В указанной валюте также будет задаваться нетто-лимит для клиента. Обязательный параметр при типе кредитования клиентов «Лимит на открытую позицию»	
При достижении уровнем маржи предельно допустимого значения запрещать открытие позиций	Запрет заявок, приводящих к открытию позиций для клиента, уровень маржи которого достиг предельно допустимого значения или опустился ниже него. Настройка решает проблему, когда позиция клиента образовала недопустимый уровень маржи, но при этом собственные средства клиента позволяют ему открыть новые позиции. Включенная настройка разрешает клиенту только операции, улучшающие его уровень маржи до тех пор, пока он не станет приемлемым	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Расчет лимита от оборота	Дополнительный параметр при типе кредитования клиентов «Лимит на открытую позицию»	
_ Нет	Учёт параметра не производится. Значение по умолчанию	
_ Без возмещения	Установленный клиенту входящий лимит (колонка «входящий лимит» Таблицы денежных лимитов) интерпретируется как лимит на дневной оборот по операциям. В дневном обороте учитываются все сделки клиента по тегу расчётов, на который установлен входящий лимит, без учёта направления, с учётом коэффициента в поле «Long» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» (по умолчанию коэффициент «Long» равен 1). Валюта лимита должна совпадать с «валютой лимитов открытых позиций на инструменте» (настраивается в описываемой странице)	
_ С возмещением	При совершении торговых операций, обратных по направлению к ранее совершенным в текущую торговую сессию операциям, значение текущего лимита восстанавливается (увеличивается), на объём совершённой операции, но не более суммы, списанной ранее	
Неполное неттирование денежных обязательств	Настройка работает при наличии у клиента нескольких денежных лимитов, текущие остатки которых суммируются при определении покупательной способности	
_ Нет	Учёт параметра не производится. Значение по умолчанию	
_ Только денег	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, клиенту будет увеличена маржинальная задолженность с целью ограничения возможности увеличивать текущие остатки на одних денежных лимитах за счёт увеличения маржинальной задолженности на других	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
_ Денег с учетом бумаг	Если некоторые из денежных лимитов имеют отрицательные текущие остатки, активы клиента будут уменьшены на величину дисконта, примененного к задолженности по валюте, превышающей обеспечение в этой же валюте. При этом: При суммировании остатков лимитов по деньгам ведется раздельный их учет в разрезе валют с учетом коэффициентов по данной валюте. При вычислении оценки позиций по бумагам ведется раздельный учет оценки позиций лонг и шорт в разрезе валют с учетом коэффициентов по инструменту	
Теги с неполным неттированием обязательств	Список тегов расчетов через запятую, при операциях по которым применяется неполное неттирование денежных обязательств. Если настройка не задана, то неполное неттирование денежных обязательств применяется к операциям по всем тегам расчетов, иначе – только по указанным в списке. Поле доступно для редактирования, если значение настройки «Неполное неттирование денежных обязательств» отлично от «Нет»	
Использовать корреляцию между инструментами	Применять настройки зависимостей между инструментами на разных рынках, используемой для расчета покупательной способности. Настройки зависимостей устанавливаются на странице «Инструменты» (см. п. 8). При включенном флажке использование корреляции разрешено для всех клиентов, при отключенном – запрещено. Настройка является глобальной и имеет более низкий приоритет по отношению к индивидуальным настройкам и настройкам клиентов по шаблону	Включен
Использовать корреляцию для заявок	Включить учёт корреляции открытых позиций и активных заявок с выставляемой заявкой при проверке достаточности средств.	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу», для которых включена настройка «Использовать корреляцию между инструментами». Настройка является глобальной и имеет более низкий приоритет по отношению к индивидуальным настройкам (см. п. 13) и настройкам клиентов по шаблону (см. п. 15)	
Ограничение максимальной денежной оценки короткой и длинной позиции	Настройка для клиентов с типом кредитования «по плечу» позволяет устанавливать ограничение на максимальную денежную оценку открытых коротких и длинных позиций по бумагам с учётом единой бумажной позиции. Без учета корреляции между инструментами и коэффициентов кредитования по бумагам. Параметры ограничений указываются в таблице «Список коэффициентов по бумагам»: Бумага – код валюты (для каждой валюты устанавливается отдельное ограничение); Long, Short – не используются, установить в «1»; Об.long, Об.short – максимальная денежная оценка в портфеле клиента суммы длинных и суммы коротких позиций, соответственно, по всем бумагам, торгуемым в заданной валюте. Ограничение настраивается на валюту, но учитывается независимо для каждого тега расчётов и может быть задано глобально, либо индивидуально на клиента (группу клиентов)	Выключен
Игнорировать отсутствие лимита на эмитента в лимите на открытую позицию	Игнорировать отсутствие ограничений на максимальный размер длинной и/или короткой позиции по бумаге, заданных в таблице «Список коэффициентов по бумагам» (параметры «Об. long», «Об. short») для всех клиентов с типом лимитирования «Лимит на открытую позицию»	
Контролировать позиции по валютам	Настройка позволяет контролировать максимально и минимально допустимые	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	размеры остатков на денежных лимитах клиента отдельно по каждой валюте в схемах лимитирования клиентов без использования лимитов по бумагам. Если настройка включена, то в таблице «Список коэффициентов по бумагам» можно задать ограничение на максимальный размер коротких и длинных позиций по валютам. Ограничение на длинную и короткую позицию по валюте задается в полях «Об. long» и «Об. short» соответственно отдельно для каждой валюты. При этом ограничения на валюту интерпретируется как ограничения на размер текущего остатка по валюте с учётом активных заявок. Оценка остатков на лимитах по бумагам не учитывается. Коэффициенты «Long» и «Short» из таблицы «Список коэффициентов по бумагам» не учитываются. Настройка является глобальной и имеет более низкий приоритет по отношению к индивидуальным настройкам и настройкам клиентов по шаблону	
Не блокировать средства под вторую часть сделки СВОП	Настройка служит для отключения блокирования средств под вторую часть СВОП сделок. Проверка и блокировка средств проводится только для первой части СВОП сделок по инструментам валютного рынка. Настройка распространяется как на «инструментальную» схему валютного лимитирования (с контролем бумажных позиций по валютным парам), так и на «денежную» схему валютного лимитирования (без контроля бумажных позиций по валютным парам и с использованием настройки «Вести денежные позиции в разрезе валют»). При отключенной настройке на видах лимитов, где должна быть учтена вторая часть СВОП-сделки, блокируется положительная разница между объёмами сделки покупки и сделки продажи	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
Учитывать лимит клиентов с кредитованием «по лимитам» при претрейд-контроле	При включенной опции для клиентов с типом кредитования «по лимитам» во время выполнения проверки лимитов через Модуль пре-трейд контроля к текущему остатку по денежным средствам добавляется значение текущего лимита	
Максимальный дневной убыток по счету	Настройка максимально допустимого значения дневного убытка по счету клиента. Значение задается в виде фиксированной суммы с указанием валюты или в виде процента от входящих средств клиента. При проведении операции происходит сравнение максимально допустимого значения убытка с разностью оценок входящих и текущих средств по счету клиента. Если убыток по счету больше допустимого, то операция запрещается (кроме операций закрытия позиций). При проведении оценки убытков все бумажные и денежные позиции клиента складываются и приводятся к валюте, в которой задано ограничение. Если ограничение задано в процентах, то пересчет происходит в «основную» валюту денежной позиции клиента. Входящие позиции по бумагам оцениваются по ценам закрытия, текущие позиции – по цене последней сделки. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по плечу». При операциях ввода / вывода средств внутри дня, проведенных в виде коррекции текущих остатков, торговые операции могут становиться доступными или недоступными для клиента в зависимости от текущего значения убытков по счету клиента. Настройка является глобальной и имеет более низкий приоритет по отношению к индивидуальным настройкам и настройкам клиентов по шаблону	
_ значение	Допустимое значение убытка по счету в течение дня	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
_ тип ограничения	Выбор типа ограничения. Возможные значения: _ процент; _ фиксированный	
_ валюта ограничения	Ввод кода валюты ограничения, например «SUR». Поле доступно, если тип ограничения – «фиксированный»	
Уровень ставки рыночного риска	Значение уровня ставки риска дисконтов КЦ. Возможные значения: неотрицательные целые числа. Настройка имеет меньший приоритет, чем настройка «Уровень ставки рыночного риска по классам» (см. п. 23)	3
Использовать настроенные дисконты	Включение настройки позволяет брать в качестве эффективных дисконтов только собственные дисконты, настроенные в разделе «Дисконты». Дисконты КЦ в этом случае игнорируются. Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ	
Параметры корректировки минимальных дисконтов	Параметры, позволяющие клиенту задание коэффициентов, корректирующих значения минимальных дисконтов	
_ Long	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по длинной позиции. Допустимая область значений: [0;1]	
_ Short	Значение корректирующего коэффициента минимального дисконта по короткой позиции. Допустимая область значений: [0;1]	
Использовать дисконты КЦ	Настройка влияет на порядок определения эффективных дисконтов по инструменту. Использование данной настройки возможно совместно с настройкой «Использовать настроенные дисконты». Путем комбинации данных настроек устанавливается необходимый брокеру порядок выбора эффективных дисконтов в различных ситуациях. Дисконты определяются в порядке согласно алгоритму Настройка	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	совместного использования собственных дисконтов и дисконтов КЦ	
Разрешать переворот позиции при ограничении портфеля	Для клиентов «МД» и «МД+»: Включение настройки позволяет выставлять заявки на переворот позиции в ситуации, когда стоимость портфеля ниже уровня скорректированной маржи. После совершения переворота позиции стоимость портфеля должна превышать уровень скорректированной маржи. Переворот не применим для портфелей с отрицательной стоимостью. Для схемы «МД+» настройка поддерживает переворот для валютных операций в денежной схеме, а также для немаржинальных активов	Выключен
Проверять значение скорректированной маржи по всем видам лимитов	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится по списку лимитов, перечисленных в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов», начиная с вида лимита, к которому привязан инструмент, класс или код расчётов. Для текущего проверяемого вида лимита используются наборы дисконтов, если такие дисконты настроены (можно использовать разные дисконты в разрезе видов лимитов). При отключенной настройке, по умолчанию, контроль соотношения стоимости портфеля и скорректированной маржи производится только на лимите плановой позиции (последний лимит из списка, указанного в настройке «Проверять обязательства по видам лимитов»)	Выключен
Запрет маржинальных покупок	Настройка поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». При включенной настройке, сервер QUIK отклоняет заявки на покупку маржинальных	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	бумаг, перечисленных в списке «Обеспечения» (см. п. 22.2), если объем заявки превышает текущий свободный остаток собственных денежных средств клиента по тегу и валюте расчетов. При отключенной настройке такая проверка не производится	
Разрешать перевод денежной задолженности в менее рисковую валюту	Если настройка включена, то заявки, закрывающие короткую позицию по валюте, разрешены даже при образовании короткой позиции по другой валюте, если при этом дисконтирующий коэффициент валюты, по которой образуется отрицательная позиция, меньше, чем по валюте, позиция по которой закрывается. Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по плечу» при использовании денежной валютной схемы	Выключен
Учитывать статус сессии при оценке позиций по бумагам	Если настройка выключена, то при оценке позиций статус сессии не учитывается. Если настройка включена, то вступает в силу усовершенствованный алгоритм поиска класса для оценки позиций по бумагам, который позволит учитывать статус сессии и оценивать позиции по наиболее актуальным данным	Выключен
Проверять продажу актива за немаржинальную валюту как вывод средств	Поддерживается для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Включение настройки позволяет запретить выставление заявок на продажу актива, входящего в обеспечение, если исполнение таких заявок приводит к ситуации УДС < 1. Требование запрета распространяется на такие продажи актива, в результате которых в портфель клиента приходит немаржинальная валюта	Выключен
Неттинг риска валютных позиций в скорректированной марже	Включение настройки позволяет использовать особую логику учета валютных позиций в скорректированной марже, при которой риск текущей валютной позиции компенсируется за счет учета этого риска в	Выключен

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	оценке потенциальной позиции по инструменту заявки с большим дисконтом. Настройка применяется только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». Данный алгоритм не следует использовать для инструментов, которые торгуются в разных режимах торгов в разных валютах. Корректность расчетов при работе с такими инструментами не гарантируется. Данная настройка не поддерживается для операций в режимах торгов, указанных в настройке «Вести денежные позиции в разрезе валют» на странице «Классы» (см. п. 7)	
Разрешать закрытие разнонаправленных позиций по валютам с одинаковым дисконтом	Включение настройки разрешает закрытие разнонаправленных позиций с равными дисконтами валют для конверсионных операций в схемах «По дисконтам» и «МД+», если не происходит переворота позиции ни по одной из валют пары. Если, согласно настройкам системы, подразумевается списание комиссии с какой-либо третьей валюты, то проверка достаточности средств под эту комиссию не осуществляется	Выключен
Не учитывать немаржинальные валюты в обеспечении	Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «по дисконтам». При включенной настройке при расчете маржинальных показателей положительные позиции по немаржинальным валютам не учитываются в обеспечении и не несут рисков. При этом операции продажи маржинального актива за немаржинальную валюту не считаются закрытием позиции (так как аналогичны выводу средств) и проверяются по маржинальным требованиям. При включенной настройке значение параметра «Проверять продажу актива за немаржинальную валюту как вывод средств» не учитывается	Выключен
Определение ставки риска фьючерса из ГО	Настройка может использоваться для определения дисконтов КЦ по фьючерсам исходя из размера ГО, транслируемого	Выключена

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	торговой системой. Для положительной позиции используется ГО покупателя, для отрицательной – ГО продавца. При невозможности расчета дисконт КЦ считается равным 1. Если задана настройка «Ограничение цены фьючерса для расчета риска» и рыночная цена фьючерса по модулю ниже заданного в настройке значения, то для определения ставки риска фьючерса используется значение цены, заданное в настройке. Рассчитанное значение может использоваться для расчета эффективных дисконтов. Поддерживается только для клиентов с типом кредитования «МД+»	
Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме МД+	Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме «МД+». О расчете минимальной маржи см. в Комментарии 3	0,5
Неттинг валютного риска в МД+	Неттировать валютный риск при расчете скорректированной маржи в схеме «МД+»	Включен
Использовать собственные дисконты активов во множествах с зависимыми ценами	Использовать собственные дисконты для инструментов во множестве с зависимыми ценами при работе по схеме «МД+». При выключенной настройке во множествах используются дисконты базового индикатора	Выключен
Не считать инструмент немаржинальным при отсутствии цен	Учитывать заданные дисконты инструмента, даже если в классах оценки для него отсутствуют цены последней сделки и закрытия. В этом случае при расчете скорректированной маржи по инструменту учитываются только цены заявок. Настройка не применяется, если по инструменту есть ненулевая позиция. Настройка применяется для клиентов с типом кредитования «МД». При использовании данной настройки настройка «Рассчитывать позиции в лотах» должна быть выключена	Выключен
Тип неттинга по умолчанию в МД+	Тип неттинга рисков по умолчанию для множеств инструментов с зависимыми ценами в схеме «МД+». Возможные значения:	Полунеттинг

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	_ «Полунеттинг» – требования к обеспечению определяются как максимальная величина риска между суммарными оценками положительных и отрицательных позиций по активам множества; _ «Неттинг» – требования к обеспечению определяются по суммарной оценке всех активов множества. Приоритет выбора типа неттинга см. в Комментарии к п. 8.9	
Активы в разных валютах в множествах МД+	Признак допустимости включения активов, цена которых выражена в разных валютах, во множества инструментов с зависимыми ценами в схеме «МД+». При использовании параметра не гарантируется соблюдение требований Указания Банка России № 5636-У	Выключен
*Кредитование клиентов	Список исключений из общего правила, установленного параметром «Кредитование клиентов по умолчанию»	
_ Код клиента	Код клиента, для которого настраивается исключение	
_ Тип кредитования	Тип кредитования, назначенный для данного кода клиента	
Вкладка «Коэффициенты»		
Список коэффициентов по бумагам	Установка коэффициентов кредитования ресурсами при продаже/ покупке по выбранной бумаге, а также максимального размера обеспечения по ней	
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента	
_ **Long	Коэффициент оценки длинной позиции по данному инструменту	
_ **Short	Коэффициент оценки короткой позиции по данному инструменту	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
_ Об. long	Максимальный размер позиции по данной бумаге, учитываемый в обеспечении маржинальных сделок, в валюте инструмента	
_ Об. short	Максимальный размер короткой позиции по данной бумаге, в валюте инструмента	
_ % откл. диск.	Параметр контроля условий для заявок в режиме РЕПО-М, устанавливающий: _ Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и нижним дисконтом для заявок на покупку; _ Максимальное отклонение в % между начальным дисконтом и верхним дисконтом для заявок на продажу	
Вкладка «Дисконты»		
Список дисконтов по бумагам	Установка дисконтов кредитования ресурсами при продаже/ покупке по выбранной бумаге. Настройка применяется для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» или «МД+». Подробнее см. комментарий к настройке в п. 13	
_ Бумага	Идентификатор (код) инструмента. Для фьючерсов при использовании схемы «МД+» в качестве значения может быть задан префикс в формате «<префикс>*»	
_ Д long	Значение дисконта брокера для длинной позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
_ Д short	Значение дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
_ Д min long	Значение минимального дисконта брокера для длинной позиции по данному	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
	инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
_ Д min short	Значение минимального дисконта брокера для короткой позиции по данному инструменту. Если значение дисконта не указано, принимается значение по умолчанию, равное 0. Подробнее см. комментарии к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
_ К long	Коэффициент ставки риска длинной позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, используется максимальное значение, транслируемое с биржи. В случае отсутствия транслируемого на бирже коэффициента для данной бумаги значение коэффициента принимается равным 1. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
_ К short	Коэффициент ставки риска короткой позиции по данному инструменту. Если значение коэффициента не указано, используется максимальное значение, транслируемое с биржи. В случае отсутствия транслируемого на бирже коэффициента для данной бумаги значение коэффициента принимается равным 1. Подробнее см. комментарий к настройке «Список дисконтов по бумагам» в п. 13	
Вкладка «Уровень рыночного риска»		
Уровень ставки рыночного риска по классам	Диапазон используемых дисконтов КЦ в разрезе классов оценки. Если класс, в котором оценивается инструмент, не добавлен в данную настройку, то для него используется настройка «Уровень ставки рыночного риска»	
_ Уровень ставки	Номер диапазона дисконтов КЦ. Возможные значения: от 0 до 255	

Параметр	Назначение	Значение по умолчанию
_ Список классов	Список классов через запятую	
Вкладка «Цены фьючерсов»		
Ограничение цены фьючерса для расчета риска	Настройка ограничения цены фьючерса для расчета параметров риска. Настройка применяется для клиентов с типом кредитования «МД+»	
_ Инструмент	Идентификатор (код) инструмента. В качестве значения может быть задан префикс в формате «<префикс>*». Настройка на код инструмента имеет более высокий приоритет относительно настройки на префикс	
_ Ограничительная цена	Цена фьючерса, используемая для расчета параметров риска, если рыночная цена фьючерса по модулю ниже заданного значения. Значение задается с точностью до 4 знаков после запятой	

* – в коде клиента возможно использование «*» на конце. В этом случае сравнение клиентского кода производится по префиксу. Префиксное совпадение проверяется, если не найдено точное совпадение клиентского кода.

** – чтобы установленные коэффициенты не влияли на расчет уровня маржи, используйте признак «Игнорировать дисконт. коэфф. в уровне маржи» на вкладке «Общие настройки» (см. п. 4.1).

> **(***) Схема ведения позиций «Валютное лимитирование» (FX) может использоваться только при наличии определенных модулей системы QUIK. Для получения подробной информации обратитесь в Службу технической поддержки QUIK: quiksupport@arqatech.com.**

В схеме кредитования «Валютное лимитирование» (FX) контроль покупательной способности ведется с учетом суммарного размера коротких позиций. Схема «FX» используется только совместно с настройкой «Вести позиции в календарных днях» для классов, включенных в настройку «Вести денежные позиции в разрезе валют».

При подаче заявки проверяется, что сумма всех коротких позиций по валютам по всем датам не превышает ограничение. Для задания ограничения и отображения текущих показателей используется лимит по базовой валюте (код валюты задается в параметре «Базовая валюта») на виде лимита Т0, который необходимо загружать до загрузки

позиций по датам. Если ограничение превышено, то допускается выставление заявок, уменьшающих задолженность без образования новой (закрытие позиций).

Для схемы используются следующие настройки: «Максимальный объем заявки» (см. п. 9), «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций» (см. п. 5), «Классы, для операций по которым не провер. запрет для клиента на проведен. торг. опер.» (см. п. 5), «Ограничения по типу инструмента и дате расчетов» (см. п. 16) и «Классы без расчёта и контроля лимитов» (см. п. 7). При этом настройка «Классы без расчёта и контроля лимитов» (см. п. 7) имеет наименьший приоритет среди них.

Комментарий 1 (к настройке «Ограничивать покупку немаржинальных бумаг»):

Действие настройки на операции ввода и вывода средств безусловно отключено, на указанные операции влияет только настройка «Ограничить вывод денежных средств».

Включение настройки не исключает вероятность того, что сделка по немаржинальной бумаге, не входящей в обеспечение, может быть совершена на заемные средства. Маржинальные ограничения проверяются не в момент совершения сделки, а в момент выставления заявки. Рассмотрим такую ситуацию на примере:

1. Пусть у клиента есть 100 рублей, плечо=2. Заемных средств=100*2=200 рублей.
2. Клиент выставляет заявку на покупку немаржинальной бумаги, не входящей в обеспечение, на 50 рублей.
3. У клиента свободно 50 рублей собственных и 50*2=100 заемных.
4. Клиент выставляет заявку на покупку маржинальной бумаги, входящей в обеспечение, на 150 рублей.
5. У клиента свободно 0 собственных и 0 заемных рублей.
6. Происходит исполнение заявки, выставленной на шаге 4.
7. У клиента появляется бумага, входящая в обеспечение на 150 руб и задолженность -50 рублей.
8. Теперь, если заявка, выставленная на шаге 2, исполнится, то произойдет покупка немаржинальной бумаги, которая не входит в обеспечение – на заемные средства. У клиента будет позиция по бумаге, входящей в обеспечение на 150 руб, задолженность -100 рублей и немаржинальная бумага, которая не входит в обеспечение на 50 рублей. Ограничительный уровень маржи при этом нарушен не будет, т.к. ограничительный уровень маржи равняется 1/(1+плечо)*100%=1/3*100%=33%.

   Уровень маржи клиента= (Активы/Лонги)=(150-100)/(150)*100%=50/150*100%=33%.

Комментарий 2 (к настройке «Ограничить операции на срочном рынке»):

При использовании данной настройки происходит потеря обратной совместимости с ранее сделанными настройками библиотеки расчета лимитов. Необходимое значение настройки должно быть установлено клиентом.

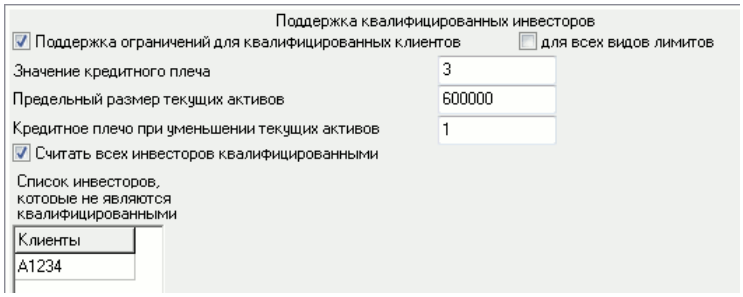
Комментарий 3 (к настройке «Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме МД+»):

В схеме «МД+» минимальная маржа рассчитывается следующим образом:

<начальная маржа>*<коэффициент, заданный в настройке «Коэффициент для расчета минимальной маржи в схеме МД+»>

24.Ограничения на ... / Квалифицированные инвесторы

24.1 Квалифицированные инвесторы

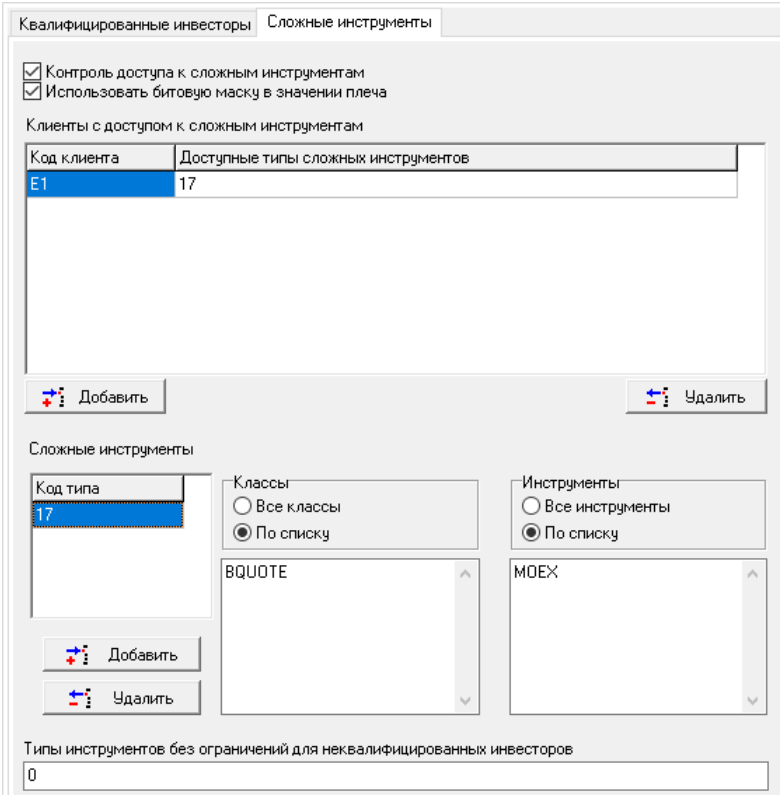


Раздел предназначен для установления списка квалифицированных клиентов и включения режима их обслуживания.

Параметр	Назначение
Поддержка ограничений для квалифицированных клиентов	Включает режим контроля размера плеча и текущих активов для квалифицированных клиентов. При включенном флажке «для всех видов лимитов» контроль осуществляется независимо от вида лимита, при выключенном контролируются только операции с видом лимита Т0
Значение кредитного плеча	Значение кредитного плеча для квалифицированных инвесторов

Параметр	Назначение
Предельный размер текущих активов	Предельное значение размера текущих активов, ниже которого квалифицированному клиенту будет снижен размер кредитного плеча
Кредитное плечо при уменьшении текущих активов	Значение кредитного плеча, если размер текущих активов квалифицированного клиента станет ниже предельного размера текущих активов
Считать всех клиентов квалифицированными	В схеме маржинального кредитования «по плечу» – признак того, что контроль размера плеча и размера текущих активов будет применяться ко всем клиентам, за исключением перечисленных в списке «Список инвесторов, которые не являются квалифицированными». Для всех схем маржинального кредитования – квалифицированному инвестору доступны операции с любыми сложными инструментами
Список инвесторов, которые являются квалифицированными / Список инвесторов, которые не являются квалифицированными	Список клиентов, на которых не распространяются настройки на этой странице. Название списка меняется в зависимости от наличия флажка в поле «Считать всех инвесторов квалифицированными»

24.2 Сложные инструменты



Параметр	Назначение
Контроль доступа к сложным инструментам	Признак проверки допустимости операций клиентов со сложными инструментами. Проверка осуществляется при подаче заявок по коду типа сложного инструмента, который транслируется из ТС или задан в списке «Сложные инструменты». По умолчанию флажок выключен (проверка не осуществляется). Для операций закрытия позиции, а также для клиентов, являющихся квалифицированными инвесторами, проверка не осуществляется. Определить инвестора квалифицированным можно с помощью комбинации настроек «Считать всех клиентов квалифицированными» и «Список инвесторов, которые являются квалифицированными / Список инвесторов, которые не являются квалифицированными» или включением клиента в шаблон «по ограничениям», в котором включен признак «Квалифицированные инвесторы»
Использовать битовую маску в значении плеча	Признак дополнительной проверки допустимости операций клиентов со сложными инструментами с помощью битовой маски (профиля СФИ – сложного финансового инструмента) из двух байт, заданной в значении плеча. В Рабочем месте QUIK клиенту устанавливается плечо. Видимое значение плеча (которое используется для привязки клиента к шаблонам по комиссии, плечу и ограничениям в параметре «Включать в шаблон клиентов со знач. плеча») определяется двумя старшими байтами; допустимый диапазон значения: [0;327.67]. Профиль сложного инструмента определяется двумя младшими байтами: каждый бит в значении маски соответствует конкретному типу сложного инструмента, соответствие битов и типов см. в Комментарии 1. ВАЖНО! _ Параметр может использоваться только для клиентов с типом кредитования «По дисконтам» и «МД+». Наличие клиентов с другим типом кредитования на сервере QUIK допустимо, если им не устанавливается плечо. _ Включение/выключение параметра вступает в силу после рестарта сервера QUIK (перезагрузки Библиотеки расчета лимитов недостаточно). Параметр доступен для редактирования, если параметр «Контроль доступа к сложным инструментам» включен. Для клиентов без установленного на денежной позиции плеча параметр не используется. Порядок проверки допустимости операции при включенном параметре «Использовать битовую маску в значении плеча» см. в Комментарии 2.

Параметр	Назначение
	Порядок определения значения плеча, которое нужно установить клиенту в Рабочем месте QUIK, см. в Комментарии 3. Для получения рекомендаций по настройке обратитесь в Службу технической поддержки QUIK: quiksupport@arqatech.com
Клиенты с доступом к сложным инструментам	Разрешение операций с определенными типами сложных инструментов (на основании кода из ТС или списка «Сложные инструменты») клиентам с указанными кодами. Параметр имеет приоритет над параметром «Доступ к сложным инструментам», заданным в шаблоне «по ограничениям»
_ Код клиента	Код клиента, которому разрешаются операции. В строке может быть указан только один код клиента. Для задания пустого кода клиента укажите значение «<EMPTY>» и включите флажки «Заявки без кода клиента» и «Рассчитывать заявки без кода клиента» (см. п. 4.1)
_ Доступные типы сложных инструментов	Список идентификаторов типов сложных инструментов через запятую
Сложные инструменты	Типы сложных инструментов в разрезе инструментов и классов
_ Код типа	Идентификатор типа сложного инструмента. Код добавляется нажатием кнопки «Добавить». Максимальная длина – 12 символов, значение может содержать заглавные латинские буквы, цифры и символ «-»
_ Классы	Коды классов сложных инструментов
_ Все классы	Все коды классов
_ По списку	Список кодов классов через запятую
_ Инструменты	Коды инструментов
_ Все инструменты	Все инструменты класса
_ По списку	Список инструментов через запятую
Типы инструментов без ограничений для неквалифицированных инвесторов	Идентификаторы типов сложных инструментов, для которых не осуществляется проверка на соответствие квалификации клиента, через запятую

Комментарий 1. Типы инструментов в профиле СФИ

Каждый бит в маске из значения плеча (профиле СФИ) соответствует типу сложного инструмента.

Тип сложного финансового инструмента «-100» (без ограничений) в профиле СФИ не учитывается.

Номер бита	Тип сложного инструмента	Описание
1	-1	Не попадает под тесты из Базового стандарта*, недоступно для неквалифицированных инвесторов, не прошедших тестирование
2	0	Предназначено для квалифицированных инвесторов согласно 39-ФЗ или эмиссионным документам
3	4	Структурные облигации, не предназначенные для квалифицированных инвесторов
4	5	Инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов, не предназначенных для квалифицированных инвесторов
5	6	Облигации российских эмитентов, которым не присвоен кредитный рейтинг либо кредитный рейтинг которых ниже установленного уровня
6	7	Облигации иностранных эмитентов, обязательства по которым исполняются за счет юридического лица, созданного в соответствии с законодательством РФ, не имеющего кредитный рейтинг или кредитный рейтинг которого ниже установленного уровня
7	8	Облигации со структурным доходом
8	9	Акции, не включенные в котировальные списки
9	10	Иностранные акции, требующие проведения тестирования
10	11	Сделки по приобретению паев иностранных ETF, требующие проведения тестирования
11	800	Облигации, запрещенные к приобретению с 01.10.2021 до 01.04.2024 для инвестора, успешно прошедшего тестирование по тесту 8
12	12	Резерв для маркировки по пункту 12 Базового стандарта*
13	13	Резерв для маркировки по пункту 13 Базового стандарта*
14	14	Резерв для маркировки по пункту 14 Базового стандарта*
15	15	Резерв для маркировки по пункту 15 Базового стандарта*
16	-999	Информация недоступна / неизвестна

* – «Базовый стандарт защиты прав и интересов физических и юридических лиц – получателей финансовых услуг, оказываемых членами саморегулируемых организаций в сфере финансового рынка, объединяющих брокеров».

Комментарий 2. Проверка допустимости операции

Если параметр «Использовать битовую маску в значении плеча» включен, то проверяется:

1. Является ли клиент квалифицированным инвестором согласно настройкам БРЛ (комбинация настроек «Считать всех клиентов квалифицированными» и «Список инвесторов, которые являются квалифицированными / Список инвесторов, которые не являются квалифицированными» или клиент включен в шаблон «по ограничениям», в котором включен признак «Квалифицированные инвесторы»):
   - да – операция разрешается;
   - нет – проверка продолжается.
2. Задан ли тип сложного инструмента в параметре «Типы инструментов без ограничений для неквалифицированных инвесторов»:
   - да – операция разрешается;
   - нет – проверка продолжается.
3. Включен ли тип инструмента в список типов профиля СФИ:
   - да – проверяется, разрешена ли операция с типом сложного инструмента, по битовой маске в значении плеча (профилю СФИ):
   - разрешена – операция разрешается;
   - не разрешена – операция запрещается.
   - нет – проверяется допустимость операции по параметрам в следующем порядке: «Клиенты с доступом к сложным инструментам», «Доступ к сложным инструментам».

Комментарий 3. Определение значения плеча для установки клиенту

1. Значение видимого плеча нужно умножить на 100, а полученный результат перевести в двоичную систему.
2. Согласно пройденным тестам нужно определить профиль СФИ клиента на основании таблицы с поддерживаемыми типами профиля СФИ. Нумерация битов направлена от младшего к старшему (от самого правого к самому левому).
3. Полученное на шаге 2 значение нужно присоединить к значению, полученному на шаге 1, путем склейки. Слева направо первым идет значение из шага 1, вторым – значение из шага 2. Значение из шага 2 должно состоять из 16 бит.

4. Полученное на шаге 3 значение нужно перевести в десятичную систему, а затем разделить на 100. Полученный результат является значением плеча, которое необходимо загрузить клиенту.

Примеры:

1. Для привязки клиента к шаблону используется плечо 234.51, при этом клиенту разрешены операции со следующими типами СФИ: 5,7,8,800,14.
2. Для привязки клиента к шаблону используется плечо 56, при этом клиенту разрешены операции со следующими типами СФИ: -1,4,5,6,7,8,9,10,11,800.

Плечо, которое нужно установить клиенту, определяется следующим образом:

	Пример 1	**Пример 2**
Видимое плечо	234.51	56
Целочисленное представление видимого плеча (*100)	23451	5600
Двоичный формат целочисленного представления видимого плеча	101 1011 1001 1011	1 0101 1110 0000
Разрешенные типы СФИ	5,7,8,800,14	-1,4,5,6,7,8,9,10,11,800
Профиль СФИ	0010 0100 0110 1000	0000 0111 1111 1101
Комбинированное плечо в двоичном формате	101 1011 1001 1011 0010 0100 0110 1000	1 0101 1110 0000 0000 0111 1111 1101
Комбинированное плечо в десятичном формате	1536894056	367003645
Плечо, которое нужно установить клиенту	15368940.56	3670036.45

25.Ограничения на ... / Доступные бумаги

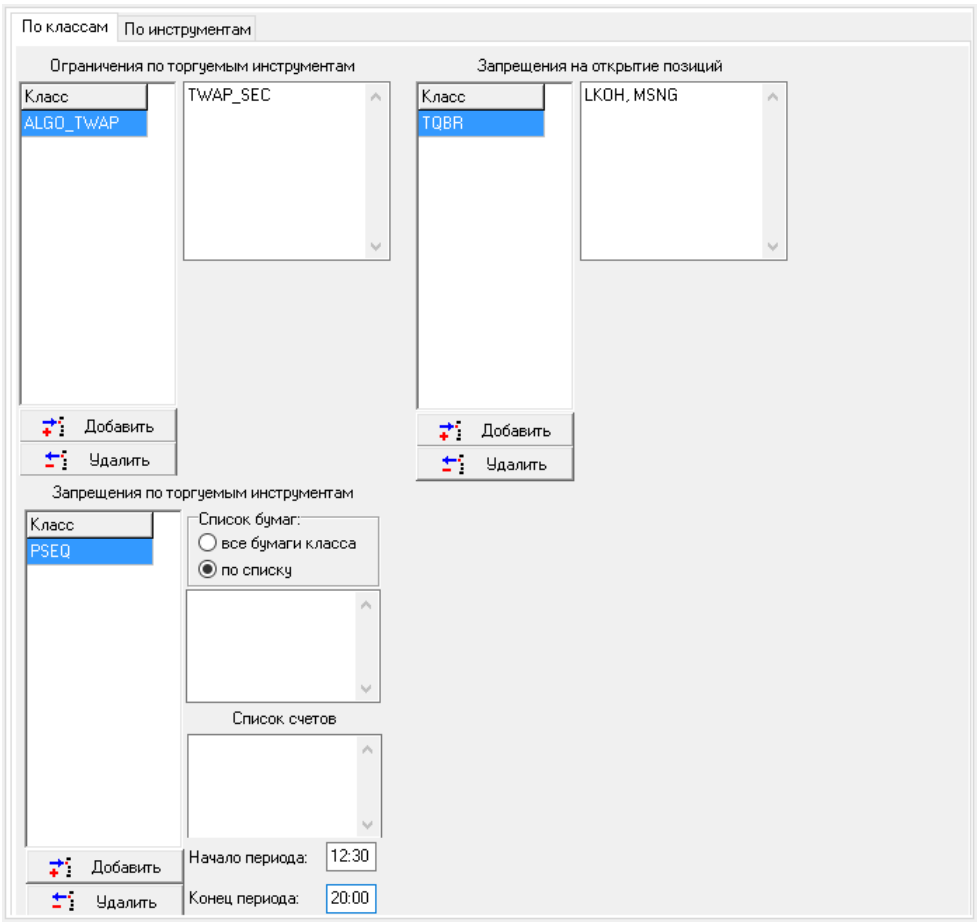
На этой странице формируется базовый список инструментов, разрешенных/запрещенных для торговли клиентам. Для определенных клиентов эта настройка по умолчанию может быть заменена индивидуальными настройками на странице «Клиенты / Комиссия брокера» в секции «Разрешенные для торговли бумаги» (см. Комментарий).

А также на странице настраиваются интервалы времени, в пределах которых всем клиентам запрещается подавать заявки по заданным инструментам и классам.

В наименовании инструмента можно использовать символ «*» на конце для обозначения всех инструментов по префиксу.

Например, в запрещениях на открытие позиций указано: класс – «TQBR», инструменты – «LKOH, MSNG».

Это означает, что по инструментам «LKOH, MSNG» запрещено открытие новых позиций, на остальные инструменты класса запрет не распространяется.



Параметр	Назначение
Вкладка «По классам»	
Ограничения по торгуемым инструментам	
_ Класс	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, разрешенных для торговли
_ Список инструментов	Список идентификаторов бумаг, разрешенных для торговли. Идентификаторы перечисляются через запятую. Для обозначения всех инструментов класса укажите «*»

Параметр	Назначение
Запрещения по торгуемым инструментам	
_ Класс	Наименование класса, в котором действует ограничение. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить». При этом могут быть выбраны все классы или наименование из списка. Если какой-либо класс включен в список «Класс», то для него будет действовать ограничение на список инструментов, запрещенных для торговли
_ Список бумаг	Список бумаг указанного класса
_ все бумаги класса	Все бумаги выбранного класса считаются запрещенными
_ по списку	Список кодов запрещенных бумаг, разделенный запятыми
_ Список счетов	Список запрещенных торговых счетов для указанного класса. Счета указываются через запятую. Необязательный параметр, по умолчанию ограничения, заданные в настройках «Класс» и «Список бумаг», распространяются на все торговые счета
_ Начало периода	Начало периода в формате <ЧЧ:ММ> для указанного класса, в течение которого запрещается подача заявок по этому классу и бумагам. На классы и бумаги, неуказанные в настройке, ограничение по времени не действует. По умолчанию: «00:00»
_ Конец периода	Окончание периода в формате <ЧЧ:ММ> для указанного класса, в течение которого запрещается подача заявок по этому классу и бумагам. На классы и бумаги, неуказанные в настройке, ограничение по времени не действует. Указанное значение может быть меньше, чем значение, заданное в поле «Начало периода». По умолчанию: «23:59»
*Запрещения на открытие позиций	
_ Класс	Наименование класса, по которому действует запрещение на открытие новых позиций, а также для наращивания (по модулю) ранее открытых позиций. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка. Если какой-либо класс включен в список, то по указанным в нем инструментам будет возможно только закрытие позиций. Для пользователей с включенной настройкой «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу настройка игнорируется. Действие настройки распространяется только на инструменты, торговля которыми не запрещена другими настройками
_ Список инструментов	Список инструментов указанного класса
Вкладка «По инструментам»	

Параметр	Назначение
***Ограничение торговли опционами	
_ Базовый актив	Код базового актива, по которому ограничиваются операции с опционами. Допустимо задание базового актива по префиксу. Поле обязательно для заполнения
_ Граничная дата исполнения	Дата в формате <ДД.ММ.ГГГГ>, которая ограничивает максимально допустимую дату экспирации опциона. Подача заявок по опционам, дата экспирации которых позже заданной даты или совпадает с ней, запрещена. Поле необязательно для заполнения, и если не задано, то ограничение на дату экспирации отсутствует
_ Максимальное отклонение страйка	Максимальное допустимое отклонение цены страйка опциона от цены последней сделки базового актива, в пунктах. Подача заявок по опционам, отклонение цены страйка которых от цены последней сделки базового актива в любую сторону больше заданного максимального отклонения, запрещена. Поле необязательно для заполнения
**Запрещенные для торговли инструменты	Настройка списка инструментов, запрещенных клиенту для совершения торговых операций. В настройке указывается код инструмента, либо его ISIN. Настройка ограничивает список запрещенных для торговли инструментов только явно заданными в ней инструментами и классами, а также направлением заявки. При этом запрещение на торговлю в данной настройке не может быть перекрыто никаким другим разрешением, в том числе настройками на вкладке «Разрешения по инструментам», описанными выше. Если для клиента задана хотя бы одна настройка для любого кода инструмента в шаблоне «По ограничениям», то все значения глобальной настройки для него не используются
_ Инструменты	Код инструмента, запрещенного клиенту для проведения торговых операций. Новый инструмент добавляется нажатием кнопки «Добавить» и вводом кода инструмента. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>
_ Все классы	На все классы для указанного инструмента
_ Классы по списку	На классы из списка ниже. Коды классов указываются через запятую

Параметр	Назначение
_ Направление	Направление заявки, которая должна быть запрещена для заданного инструмента в заданном режиме (режимах). Возможные значения: _ «Не задано» (по умолчанию); _ «Покупка» – ограничение распространяется на заявки на покупку; _ «Продажа» – ограничение распространяется на заявки на продажу
Ограничения по типу инструмента и дате расчетов	Запрет операций в зависимости от типа инструмента, направления, срока расчетов по операции. Используется только для схемы кредитования «Валютное лимитирование» (FX)
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Для обозначения всех классов укажите <ALL>
_ Тип инструмента	Тип инструмента операции. Возможные значения: _ «NOTSPECIFIED» (по умолчанию) – не выбрано; _ «SPOT» – СПОТ; _ «FORWARD» – форвард; _ «SWAP» – валютный своп; _ «TIME_DEPOSIT» – депозит; _ «CERTIFICATE_OF_DEPOSIT» – депозит НСО (неснижаемый остаток); _ «PMSPOT» – СПОТ, металлическая пара; _ «NDF» – беспоставочный форвард; _ «FLEXFORWARD» – форвард с произвольной датой расчетов
_ Направление	Направление операции. Возможные значения: _ «Не задано» (по умолчанию) — любое направление; _ «Покупка»; _ «Продажа»
_ Срок	Срок расчетов. Значение по умолчанию: «0» — запрет операций с инструментами выбранного типа независимо от срока (полный запрет операций с данным типом)
Разрешенные коды ISIN	Список кодов ISIN инструментов через запятую, операции с которыми разрешены. Значение в списке также может быть задано в виде префикса с символом «*» в формате «<префикс>*». Параметр не учитывается для пользователей с включенной опцией «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции, а также для операций на валютном и срочном рынках. Параметр имеет меньший приоритет, чем заданный в шаблонных настройках на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям» (см. п. 16)

Параметр	Назначение
Разрешать закрытие позиций для инструментов с недопустимыми ISIN	Признак разрешения операций закрытия по инструментам, коды ISIN которых не указаны в параметре «Разрешенные коды ISIN». Параметр имеет меньший приоритет, чем заданный в шаблонных настройках на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям» (см. п. 16)

* – о применении см. комментарий к п. 10.

** – настройка имеет меньший приоритет по отношению к аналогичной настройке на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям», п. 16.

> **(***) Комментарии к параметру «Ограничение торговли опционами»:**
>
> 1. **Параметр проверяется позже, чем параметры «Ограничения по торгуемым инструментам» и «Запрещения по торгуемым инструментам». Это означает, что если торговля ограничена какой-либо из двух последних перечисленных параметров, то заявка по опциону отвергается.**
> 2. **Параметр действует как для клиентов, использующих модуль ЕДП, так и для клиентов, не использующих ЕДП.**
> 3. **Действие параметра не распространяется на:**
>   - клиентов, у которых в правах на соответствующий класс, к которому относятся опционы на ограниченный базовый актив, включен параметр «Игнорировать отсутствие лимитов».
>   - операции досрочного исполнения опционов на ФОРТС.
>   - заявки, исполнение которых вызывает сокращение или полное закрытие текущей позиции по опциону.

26. Ограничения на ... / По бумагам на счета

На данной странице настраивается проверка возможности отправки клиентом заявки с указанного торгового счета по конкретной бумаге.

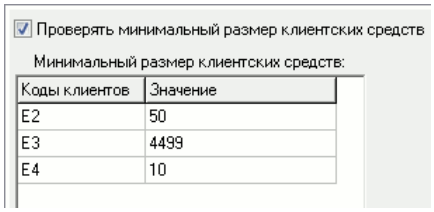
Параметр	Назначение
Разрешения по инструментам на торговые счета	Настройка списка бумаг, доступных клиентам для покупки или продажи по указанному торговому счету. Если список разрешений не пуст, то _ для указанного торгового счета заявки на бумаги, не включенные в данный список, будут запрещены; _ заявки, поданные с других торговых счетов на бумаги, включенные в данный список, будут запрещены. Запрет распространяется также на заявки закрытия позиций. Настройка не распространяется на клиентов срочного рынка
_ Торговый счет	Код торгового счета
_ Список инструментов	Список инструментов через запятую
Ограничения по инструментам на торговые счета	Настройка списка бумаг, недоступных клиентам для ввода заявок по указанному торговому счету. Настройка не распространяется на клиентов срочного рынка. Запрет распространяется также на заявки закрытия позиций
_ Торговый счет	Код торгового счета. Допускается указание торговых счетов по префиксу с использованием символа «*» в названии счета
_ Список инструментов	Список инструментов через запятую

Например, в ограничении по инструментам указаны:

- Торговый счет – «Y01-00000F00», Список инструментов – «LKOH, RTKM»;
- Торговый счет – «S01*», Список инструментов – «RTKM».

Это означает, что операции по «RTKM» запрещены со счета «Y01-00000F00» и счетов начинающихся на «S01», с «LKOH» – с единственного счета – «Y01-00000F00». По другим инструментам нет ограничений на счета.

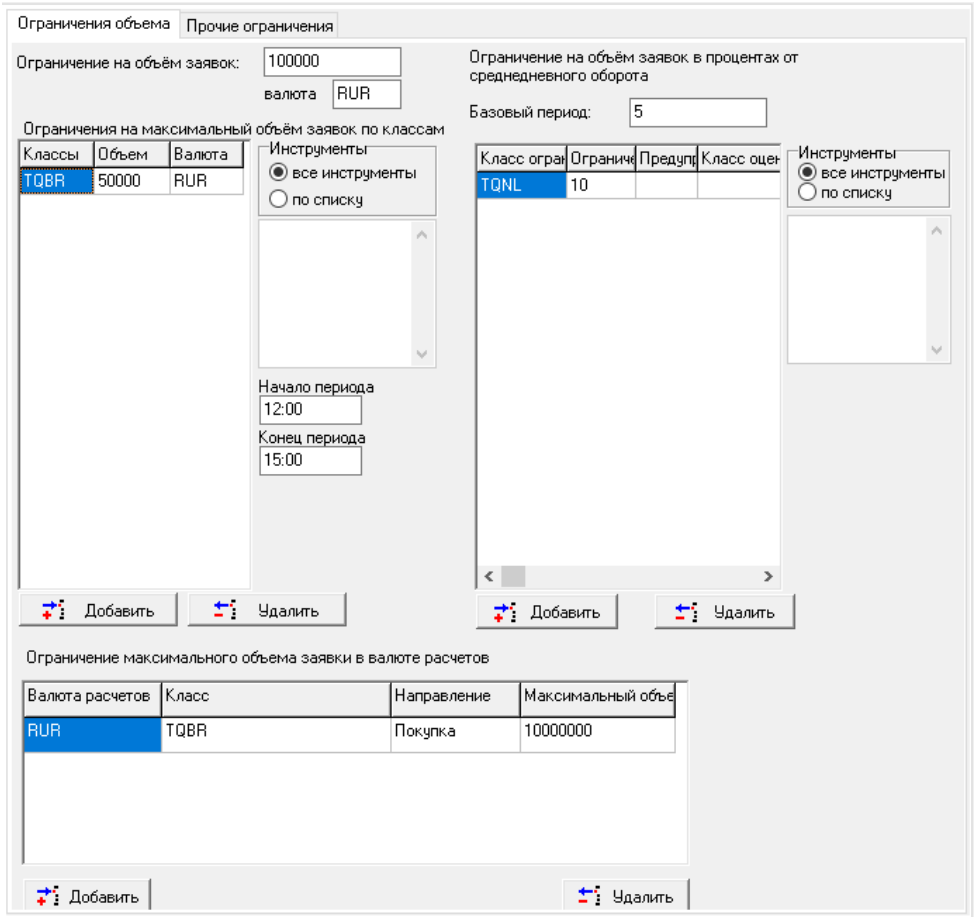
27.Ограничения на ... / Минимальный размер клиентских средств



На этой странице настраивается проверка минимального размера (оценки) собственных средств клиентов, при соблюдении которого разрешается совершение торговых операций.

Параметр	Назначение
Проверять минимальный размер клиентских средств	Включает проверку минимально допустимого размера (оценки) собственных средств клиентов
Минимальный размер клиентских средств	Настройка списка доступна при включенном режиме «Проверять минимальный размер клиентских средств»
_ Коды клиентов	Код клиента
_ Значение	Минимально допустимая величина собственных средств, в валюте расчетов

28.Ограничения на ... / Объем заявок



Данная страница предназначена для ограничения максимального размера выставляемой клиентом заявки, а также максимального размера позиции. Если значения в полях не заданы, то проверка на объем заявки и размер позиции не осуществляется.

Если ограничение установлено, то оно распространяется и на адресные заявки с кодом расчетов «S». Комиссия брокера с объема в заявке, а также прочие удержания и начисления не учитываются при проверке превышения заданного ограничения.

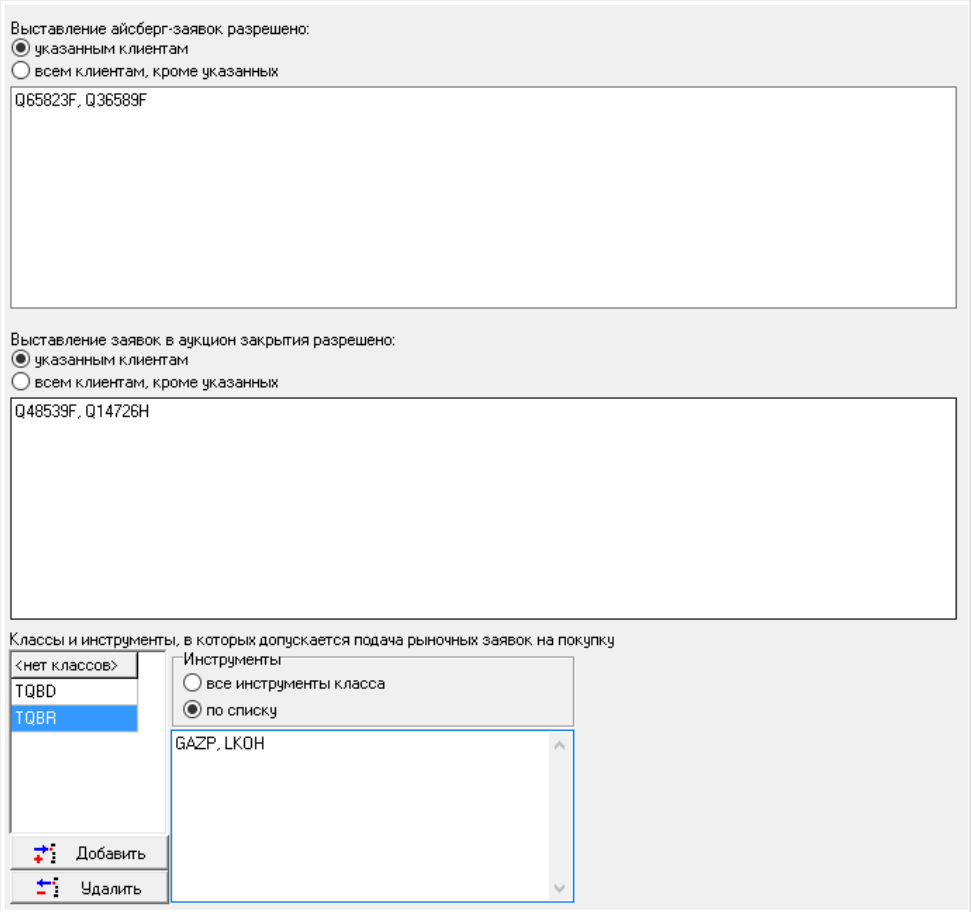
Параметр	Назначение
Вкладка «Ограничения объема»	
Ограничение на объем заявок	Размер ограничения на объем заявок вне зависимости от режима торгов, выраженный в валюте, указанной в поле «валюта»
_ валюта	Валюта, в которой выражается объем выставляемой заявки
Ограничения на максимальный объем заявок по классам	Содержит список индивидуальных ограничений для различных классов. Все строки в данной настройке имеют равный приоритет. Если величина объёма в проверяемой заявке нарушает хотя бы одно из ограничений, заявка отклоняется
_ Классы	Код класса или список кодов классов через запятую. Для обозначения всех классов укажите <ALL>. Следует учитывать, что наличие любой индивидуальной настройки на класс отменяет проверку для этого класса общей для всех классов настройки «Ограничение на объём заявок». В частности, любая строка с использованием значения <ALL> в качестве списка классов отменяет проверку настройки «Ограничение на объём заявок»
_ Объём	Размер ограничения для заявок по инструментам указанного класса. Допускается пустое значение - ограничение на объём заявки отсутствует
_ Валюта	Валюта, в которой устанавливается размер ограничения для заявок. Допускается пустое значение - ограничение рассчитывается в валюте расчётов. Для конвертации используются значения кросс-курсов сервера QUIK
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на максимальный объем заявок действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на максимальный объем заявок. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
_ Начало периода	Время начала периода, в течение которого действует ограничение на максимальный объем заявок, в формате <ЧЧ:ММ>

Параметр	Назначение
_ Конец периода	Время окончания периода, в течение которого действует ограничение на максимальный объем заявок, в формате <ЧЧ:ММ>. Допускается указывать значение конца периода меньшее, чем значение начала периода
Ограничение на объем заявок в процентах от среднедневного оборота	Содержит список индивидуальных ограничений на объем заявок в процентах от среднедневного объема торгов для различных классов. Настройка распространяется на все рынки и классы, если они заданы в параметре «Класс ограничения». Среднедневной оборот рассчитывается сервером QUIK при старте на основе архивных данных. Ведение архива дневных объемов торгов обеспечивается Модулем ведения архивов. Его использование обязательно. Для работы настройки необходимо обеспечить наличие в архиве (Модуль ведения архивов) значения параметра «Оборот» (valtoday). При расчете среднедневного оборота дни с нулевым оборотом и дни, по которым отсутствуют архивные данные, не учитываются. Действие данной настройки распространяется также на заявки, закрывающие позицию. Если ограничение для конкретной пары «Класс» + «Инструмент» задано в настройке из шаблона (см. п. 16), то оно отменяет ограничение, заданное на такую же пару «Класс» + «Инструмент» в данной настройке.
Базовый период	Количество календарных дней, для которого определяется среднедневной оборот. Параметр обязателен для заполнения. Если базовый период не указан, настройка неактивна и не используется вне зависимости от указания других параметров
_ Класс ограничения	Список классов, по которым задается ограничение. Обязательно к заполнению при указании данных в других столбцах
_ Ограничение, %	Процент, ограничивающий максимальный объем заявки от среднедневного оборота. Параметр обязателен для заполнения
_ Предупреждение, %	В настоящее время не используется
_ Класс оценки	Режим торгов, среднедневной объем по которому используется при расчете максимально возможного объема заявки. Если для оценки заявок в определенном режиме требуется использовать оборот в этом же режиме, то параметр не указывается. Для корректной работы настройки на сервер должны транслироваться описания инструментов по режиму торгов, соответствующему классу оценки

Параметр	Назначение
_ Инструменты	Список инструментов указанного класса
_ все инструменты	Ограничение на максимальный объем заявок действует на все инструменты класса
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует ограничение на максимальный объем заявок. Допускается пустой список - этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты».
Ограничение максимального объема заявки в валюте расчетов	Контроль максимально допустимого объема операции с учетом класса, валюты расчетов и направления операции. Не учитывается для операций на срочном рынке
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, для которого действует ограничение
_ Направление	Направление операции. Для операций РЕПО задается направление первой части. Возможные значения: _ «Покупка»; _ «Продажа»; _ «Не задано»
_ Максимальный объем	Максимальный объем операции
Вкладка «Прочие ограничения»	

Параметр	Назначение
Ограничение максимального размера позиции	Настройка позволяет задать ограничения максимального размера позиции в разрезе инструментов для длинных и коротких позиций, действующие на одного клиента. Ограничение может быть настроено на любой актив фондового, валютного или срочного рынка. Ограничения по срочным инструментам и валютам (на код валюты) задаются в штуках. Ограничения по бумагам (включая валютные пары в инструментальной валютной схеме) задаются в штуках или в лотах в зависимости от значения настройки «Рассчитывать позиции в лотах» в «Общих настройках библиотеки. Часть 3» (подробнее см. п. 4.3). Ограничения в настройке по шаблону на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям» (см. п. 16) переопределяют ограничения из данной настройки, заданные на тот же инструмент. Ограничения на инструменты, перечисленные в настройке по шаблону, но отсутствующие в данной настройке, дополняют данную настройку. Настройка не поддерживается для схем кредитования «Лимит на открытую позицию» (МОП) и «По лимитам», а также для бинарных опционов. Ограничения данной настройки не проверяются при выполнении операции закрытия позиции.
_ Инструменты	Список кодов инструментов через запятую. Параметр обязателен для заполнения
_ Огр. длин. поз.	Максимальный допустимый размер длинной позиции. Поле необязательно для заполнения
_ Огр. корот. поз.	Максимальный допустимый размер короткой позиции. Поле необязательно для заполнения

29.Ограничения на ... / Типы заявок



На странице настраиваются разрешения на подачу следующих типов заявок:

- Айсберг-заявок и заявок в аукцион закрытия по заданному списку кодов клиентов. Настройки распространяются на клиентов с любым типом кредитования и проверяются при проверке новых заявок. При пустом списке кодов клиентов проверка настроек не выполняется.
  В случае срабатывания запрета по одной из настроек формируется диагностика «Операции по данному клиентскому коду запрещены».
- Рыночных заявок на покупку по заданному списку инструментов определенного класса. Действие данной настройки зависит от настройки «Рыночные заявки на покупку» следующим образом:
  - Если настройка «Рыночные заявки на покупку» включена, то:
    - для классов, указанных в настройке «Классы и инструменты, в которых допускается подача рыночных заявок на покупку», подача рыночных заявок на покупку допускается только по инструментам, перечисленным для конкретного класса;
    - для классов, не указанных в настройке «Классы и инструменты, в которых допускается подача рыночных заявок на покупку», подача рыночных заявок на покупку допускается по любому инструменту.

- Если настройка «Рыночные заявки на покупку» выключена, то подача рыночных заявок на покупку допускается только по инструментам, перечисленным для конкретного класса в настройке «Классы и инструменты, в которых допускается подача рыночных заявок на покупку».

Настройка игнорируется в следующих случаях:

- Выставление заявок во время периода закрытия торговой сессии;
- Подача заявок по классу, указанному в настройке «Классы без расчёта и контроля лимитов».

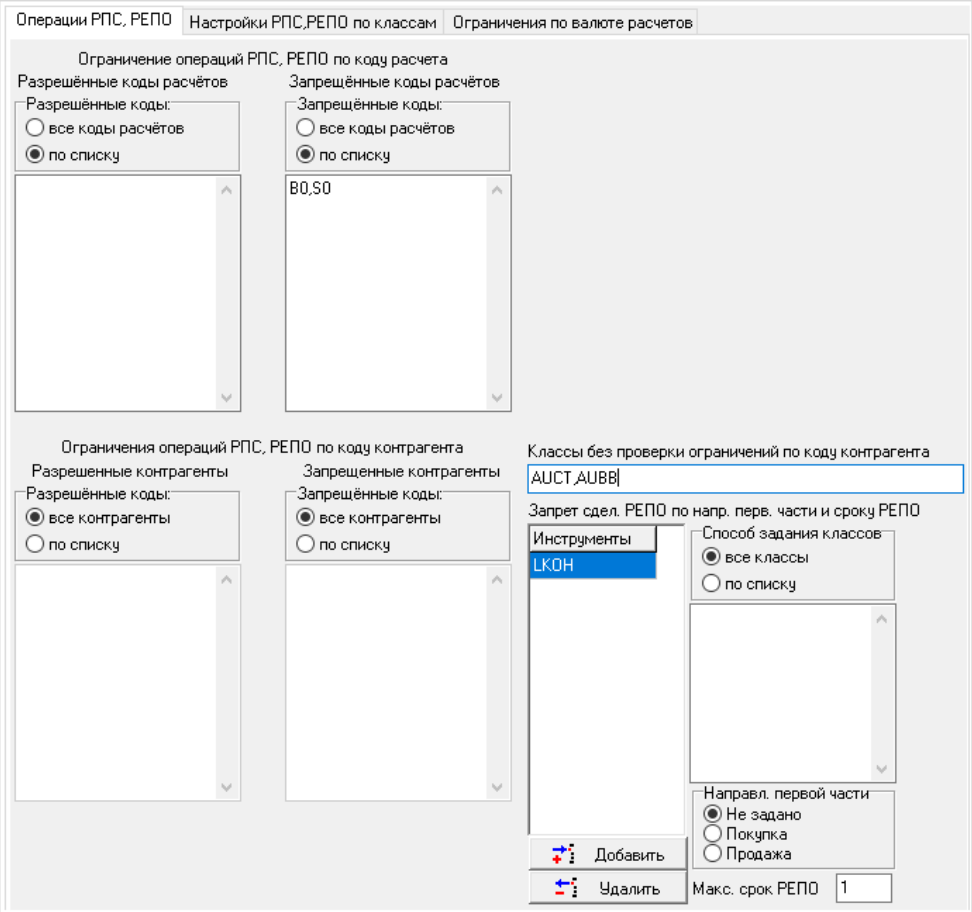
> **По классам и инструментам, по которым разрешена подача рыночных заявок на покупку, сервер QUIK резервирует в поле «Заблокировано» Таблицы лимитов по деньгам необходимую сумму (см. Комментарий к п. 4.2).**

Параметр	Назначение
Выставление айсберг-заявок разрешено:	Список кодов клиентов, перечисленных через запятую, для которых выставление айсберг-заявок разрешено. Допустимо использование префикса клиентских кодов. Настройка имеет более низкий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Другие параметры» / «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций» см. п. 5
- Указанным клиентам	Разрешено указанным в списке клиентам
- Всем клиентам, кроме указанных	Разрешено всем клиентам, кроме указанных в списке. Значение по умолчанию
Выставление заявок в аукцион закрытия разрешено:	Список кодов клиентов, перечисленных через запятую, для которых выставление заявок в аукцион закрытия разрешено. Допустимо использование префикса клиентских кодов. Настройка имеет более низкий приоритет по сравнению с настройкой на странице «Другие параметры» / «Клиенты, для которых запрещено проведение торговых операций» см. п. 5
- Указанным клиентам	Разрешено указанным в списке клиентам
- Всем клиентам, кроме указанных	Разрешено всем клиентам, кроме указанных в списке. Значение по умолчанию
Классы и инструменты, в которых допускается подача рыночных заявок на покупку	
- Класс	Наименование класса, в котором разрешена подача рыночных заявок на покупку. Новый класс добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка
- Инструменты	Список инструментов указанного класса

Параметр	Назначение
_ все инструменты класса	По всем инструментам выбранного класса разрешена подача рыночных заявок на покупку
_ по списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, по которым разрешена подача рыночных заявок на покупку

30.Ограничения на ... / Операции РПС, РЕПО

Данная страница предназначена для настройки глобальных ограничений для клиентов на операции РПС и РЕПО.



Параметр	Назначение
*Вкладка «Операции РПС, РЕПО»	
Ограничение операций РПС, РЕПО по коду расчета	

Параметр	Назначение
Разрешённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, разрешённых для операций РПС, РЕПО
_ все коды расчётов	Разрешены все коды расчетов
_ по списку	Разрешены коды расчетов, перечисленные в списке через запятую. Использование префикса кода расчетов не допускается
Запрещённые коды расчётов	Настройка списка кодов расчетов, запрещенных для операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных кодов
Ограничения операций РПС, РЕПО по коду контрагента	
Разрешенные контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую. Указание префикса контрагента не допускается. Настройка имеет смысл, только если в настройке «Запрещенные контрагенты» выбрано значение «Все контрагенты»
Запрещенные контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО. Правила настройки те же, что и для разрешенных контрагентов
Классы без проверки ограничений по коду контрагента	Список классов через запятую, для которых не проверяются ограничения на контрагентов
***Запрет сдел. РЕПО по напр. перв. части и сроку РЕПО	Запрет операций с определенными инструментами как с учетом направления сделки первой части, так и с учетом срока РЕПО. Настройка действует только для классов, имеющих признак «Класс РЕПО» и/или «Класс модифицированного РЕПО» и/или «РЕПО с ЦК». Если для пользователя включены настройки «Игнорировать отсутствие лимитов» в правах по классу операции, или «Игнорировать проверку для адресных заявок» (учитывается только в случае подачи адресной заявки), то данная настройка для него не учитывается
_ Инструменты	Список кодов инструментов, на которые действует ограничение. Для обозначения всех инструментов класса укажите <ALL>
_ Способ задания классов	Способ задания классов, на которые действует ограничение
_ Все классы	Ограничение действует для всех классов РЕПО, в которых торгуется заданный инструмент

Параметр	Назначение
_ По списку	Список классов через запятую, на которые действует ограничение
_ Направл. первой части	_ «Не задана» (по умолчанию); _ «Покупка»; _ «Продажа»
_ Макс. срок РЕПО	Максимально допустимый срок РЕПО (если срок сделки больше указанного, операция запрещена), задается целым числом
**Вкладка «Настройки РПС, РЕПО по классам»	
Разрешенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО. Настройка имеет смысл, только если в настройке «Запрещённые контрагенты и коды расчётов РЕПО/РПС в разрезе классов» выбрано значение «Все контрагенты»
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми разрешено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Разрешены все контрагенты
_ По списку	Разрешены контрагенты, перечисленные в списке через запятую.
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»

Параметр	Назначение
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки меньше или равен указанному, операция разрешена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»
Запрещенные контрагенты и коды расчетов РЕПО/РПС в разрезе классов	Настройка списка контрагентов и кодов расчетов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО в выбранных классах с учетом направления сделки и срока сделки РЕПО
_ Классы	Тип классов или класс, в котором действует ограничение. Новый тип классов (или класс) добавляется нажатием кнопки «Добавить» и выбором наименования из списка: _ «Все классы РЕПО»; _ «Все классы РПС»; _ «Все классы РЕПО с ЦК»; _ «Все классы РПС с ЦК»; _ «Выбор класса из списка» – выбор наименования класса из списка доступных. Ограничения, заданные на тип классов и на отдельный класс, имеют одинаковый приоритет. Параметр обязателен для заполнения
_ Коды расчётов	Список кодов расчетов через запятую. Параметр необязателен для заполнения
Контрагенты	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций РПС и РЕПО
_ Все контрагенты	Запрещены все контрагенты
_ По списку	Запрещены контрагенты, перечисленные в списке через запятую
Направление	Направление сделки (для РЕПО – направление первой части сделки). Параметр необязателен для заполнения. Возможные значения: _ «Не задано»; _ «Покупка»; _ «Продажа»
Макс. срок РЕПО	Максимальный срок сделки РЕПО (если срок сделки больше указанного, операция запрещена). Поле недоступно для редактирования, если список классов пуст, и для типов классов «Все классы РПС» или «Все классы РПС с ЦК»
Вкладка «Ограничения по валюте расчетов»	

Параметр	Назначение
Запрет операций с контрагентом по валюте расчетов	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций на фондовом и валютном рынках в указанных классах с учетом валюты расчетов и инструмента (задается в рамке «Инструменты»). Настройка учитывается только для адресных операций
_ Контрагент	Контрагент, с которым запрещено проведение операций
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, в котором действует запрет
_ Инструменты	Список инструментов
_ Все инструменты	Запрет на проведение операций действует на все инструменты
_ По списку	Список кодов инструментов, разделенных запятыми, на которые действует запрет на проведение операций. Допускается пустой список – этот случай эквивалентен выбору значения «все инструменты»
Ограничение операций РЕПО с контрагентом по сроку РЕПО	Настройка списка контрагентов, с которыми запрещено проведение операций в зависимости от класса, валюты расчетов операции, валюты номинала инструмента и срока РЕПО. Настройка учитывается только для адресных операций РЕПО
_ Контрагент	Контрагент, с которым запрещено проведение операций
_ Валюта расчетов	Валюта расчетов, для которой действует запрет
_ Валюта номинала	Валюта номинала инструмента, для которой действует запрет
_ Класс	Код класса, в котором действует запрет
_ Максимальный срок РЕПО	Максимально допустимый срок РЕПО

* – приоритет использования настроек см. в Комментарии 6

** – приоритет, особенности и примеры использования настроек см. в Комментарии 5

*** – настройка имеет меньший приоритет по отношению к аналогичной настройке на странице «Клиенты / Шаблоны / По ограничениям», п. 16.

31.Дополнительные ограничения

Дополнительные ограничения могут быть проигнорированы пользователем, у которого включено право «Игнорирование дополнительных ограничений». Право включается в окне

редактирования пользователя программы QUIK Administrator (вкладка «Общие права», таблица «Клиентские модули»).

> **Не рекомендуется включать право на модуль «Игнорирование дополнительных ограничений» глобально для всех пользователей системы QUIK.**

Возможность игнорирования дополнительных ограничений действует для следующих операций:

- Ввод заявки;
- Ввод адресной заявки;
- Ввод адресной заявки РЕПО;
- Биржевая замена заявки.

Настройки дополнительных ограничений аналогичны одноимённым настройкам основных ограничений.

> **Настройки дополнительных ограничений доступны только при включённой настройке «Проверять дополнительные ограничения» (Общие параметры / Общие настройки библиотеки. Часть 1).**

Дополнительное ограничение	Основное ограничение	Описание
Клиенты / Шаблоны / По комиссии, вкладка «Д.О.: Ограничение цен заявок»	Клиенты / Шаблоны / По комиссии, вкладка «Ограничение цен заявок»	п. 14
Клиенты / Шаблоны / По комиссии, вкладка «Д.О.: Запреты РПС,РЕПО по классам»	Клиенты / Шаблоны / По комиссии, вкладка «Запр. РПС,РЕПО по классам»	п. 14
Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Д.О.: Запрещения по инструментам»	Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Запрещения по инструментам»	п. 16
Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Д.О.: Огр. объема заяв. от об.»	Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Огр. объема заяв. от об.»	п. 16
Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Д.О.: Запрет по контрагенту и валюте расчетов»	Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Запрет по контрагенту и валюте расчетов»	п. 16
Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Д.О.: Ограничение по контрагенту и сроку РЕПО»	Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Ограничение по контрагенту и сроку РЕПО»	п. 16
Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Д.О.: Ограничение по объему и валюте расчетов»	Клиенты / Шаблоны / По ограничениям, вкладка «Ограничение по объему и валюте расчетов»	п. 16

Дополнительное ограничение	Основное ограничение	Описание
Дополнительные ограничения / Цены заявок	Ограничения на … / Цены заявок	п. 20
Дополнительные ограничения / Доступные бумаги	Ограничения на … / Доступные бумаги	п. 25
Дополнительные ограничения / Объём заявок	Ограничения на … / Объём заявок	п. 28
Дополнительные ограничения / Операции РПС, РЕПО	Ограничения на … / Операции РПС, РЕПО	п. 30

Если право «Игнорирование дополнительных ограничений» включено, то при нарушении дополнительного ограничения пользователю выдаётся соответствующее предупреждение, которое пользователь может отклонить.

После игнорирования ограничений осуществляется повторная проверка ограничений, которые не были нарушены. Транзакция подаётся, если все нарушенные ограничения проигнорированы или ни одно ограничение не нарушено.

Дополнительные ограничения, которые ранее были нарушены и проигнорированы пользователем, повторно не проверяются. Список уже проигнорированных ограничений очищается при перезагрузке настроек Библиотеки расчёта лимитов и при изменении размера плеча для клиентов типа «МД».

Если нарушены основные ограничения, то транзакция отвергается, независимо от результатов проверки дополнительных ограничений. Уведомление о нарушении дополнительных ограничений в этом случае не выдаётся.

Возможность игнорирования дополнительных ограничений отсутствует в следующих случаях:

- Если право «Игнорирование дополнительных ограничений» выключено.
- Если по данному классу включено право «Работа с подтверждениями».
- Для транзакций, поданных сервером QUIK в результате активации стоп-заявок.
- При использовании субброкерской схемы – для всех ограничений вышестоящих счетов.

32.Списки маржинальных бумаг

Настройка списков маржинальных бумаг для лимитов указанного вида. Форма настроек открывается при нажатии на кнопку «Списки маржинальных бумаг» из разделов «Клиенты / Настройки "плеча"» и «Клиенты / Шаблоны / По "плечу"». При нажатии на кнопку «Сохранить и закрыть» все настройки сохраняются, и форма закрывается.

Маржинальные бумаги в заданном классе

Индивидуальная настройка списка инструментов, разрешенных для маржинальных сделок. Настраивается по следующему правилу:

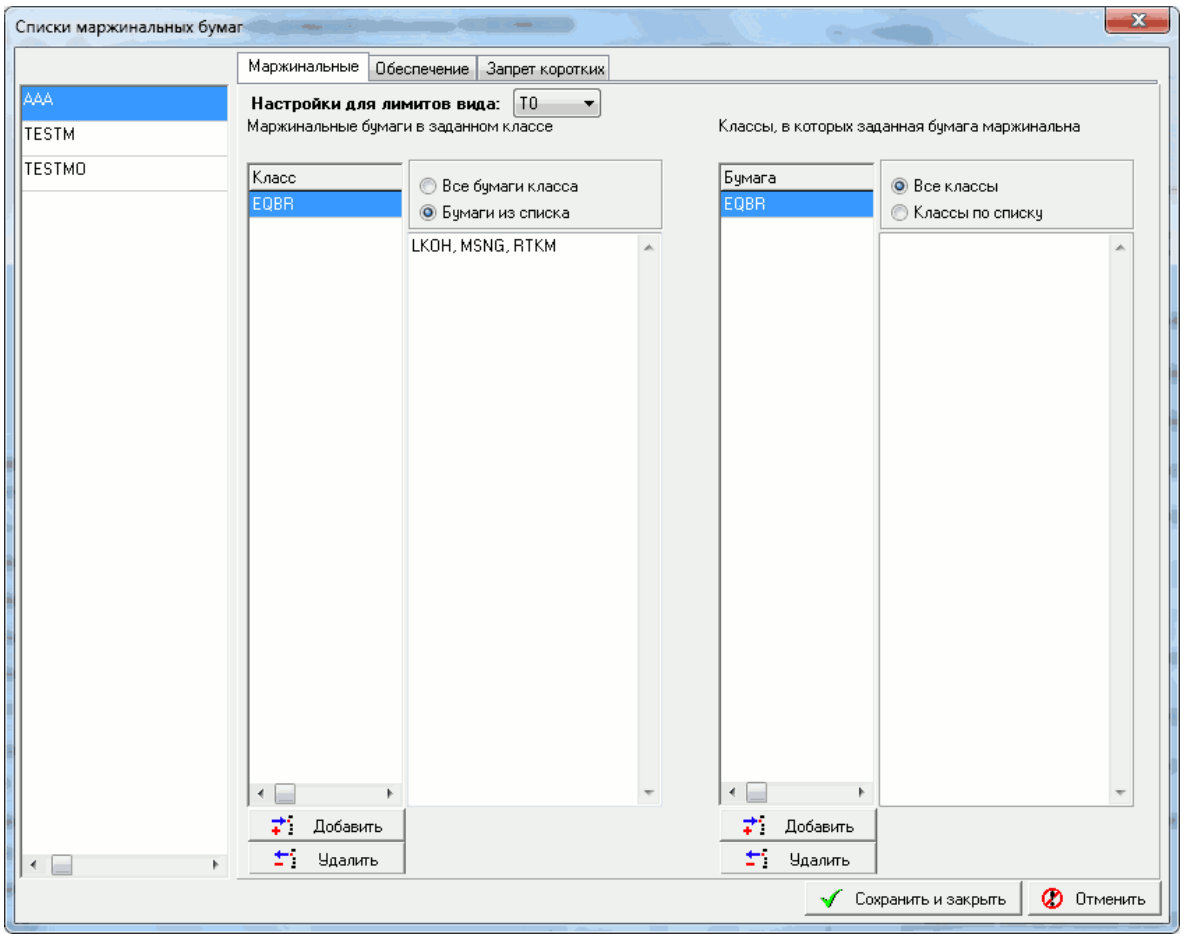
- Выбирается клиент или шаблон, для которого будет производиться настройка;
- Выбирается вид лимита. При этом все настройки раздела распространяются на операции, «привязанные» к указанному виду лимита. Такая привязка осуществляется по режиму торгов операции и определяется настройкой «Привязка классов к видам лимитов»;
- В список классов добавляется новый класс;
- В правом окне через запятую указывается список используемых инструментов для выбранного класса, либо выбирается значение «Все бумаги класса».

Классы, в которых заданная бумага маржинальна

Индивидуальная настройка списка классов, в котором для выбранного инструмента разрешены маржинальные сделки. Настраивается по следующему правилу:

- В список бумаг добавляется новая бумага;
- В правом окне через запятую указывается список классов, использующих данный инструмент, либо выбирается значение «Все классы».

> **Настройка «Маржинальные бумаги в заданном классе» имеет более высокий приоритет, чем настройка «Классы, в которых заданная бумага маржинальна».**



> **Комментарий к настройкам «Маржинальные бумаги в заданном классе» и «Классы, в которых заданная бумага маржинальна»:**
>
> Для удобства изложения «Маржинальные бумаги в заданном классе» назовем «По классам», а «Классы, в которых заданная бумага маржинальна» – «По бумагам».

1. Фактически, в силу более высокого приоритета, если к классу применяется настройка «По классам», то настройка «По бумагам» для этого класса не используется.

   Пример: Настройка «По бумагам» для бумаги «LKOH» имеет значение «Все классы», а настройка «По классам» для класса «BQUOTE» содержит список из бумаг «GAZP» и «SBER». Таким образом, во всех классах, кроме класса «BQUOTE», бумага «LKOH» является маржинальной. Бумаги «GAZP» и «SBER» являются маржинальными только в классе «BQUOTE».

   При настройке такой схемы инструмент (в примере «LKOH») в настройке «По классам» надо прописывать (в списке «Разрешённые бумаги» для класса «BQUOTE») явно, иначе настройка «По классам» для этого инструмента будет работать как исключение из настройки «По бумагам».

2. Если отсутствует индивидуальная настройка «По классам», но задана индивидуальная настройка «По бумагам» и глобальная настройка «По классам», то (в силу приоритета настроек «По классам») к классу инструментов в первую очередь будет применяться глобальная настройка «По классам». В этом случае, для инструментов из классов,

перечисленных в списке глобальной настройки, индивидуальная настройка «По бумагам» для клиента не будет использоваться.

Пример: При настройке индивидуального списка «По бумагам» в клиентском шаблоне без одновременной настройки индивидуального списка «По классам» в этом же шаблоне, настройки исключений признака маржинальности берутся из глобального списка «По классам».

Рекомендуется настраивать список «По бумагам» на том же уровне вложенности настроек, что и список «По классам» (использовать сочетание глобальных настроек «По бумагам» и «По классам» для всех пользователей, либо в случае настройки индивидуального списка «По бумагам» в клиентском шаблоне, одновременно настраивать индивидуальный список «По классам» в этом же шаблоне).

32.1 Список «Обеспечение»

Индивидуальная настройка списка инструментов, принимаемых в обеспечение у клиента и/или списка классов, принимающих выбранный инструмент в обеспечение. Настраивается по тем же правилам, что и предыдущий список.

Для клиентов с типом кредитования «по дисконтам» инструменты из списка «Обеспечение» учитываются настройкой «Запрет маржинальных покупок» (см. п. 13, п. 15).

32.2 Список «Запрет коротких»

Индивидуальная настройка списка инструментов, по которым данному клиенту запрещено создавать короткие позиции по ценным бумагам и опционным контрактам и/или списка классов, в которых для выбранного инструмента установлен запрет коротких позиций. Правила настройки те же.

Параметр	Назначение
Бумаги, запрещенные для открытия коротких позиций в заданном классе	Настройка списка инструментов, по которым запрещено создание коротких позиций
_ Класс	Выбор класса инструментов, по которому запрещено создание коротких позиций
_ Все бумаги класса	Запрет распространяется на все инструменты класса
_ По списку	Запрет распространяется на инструменты из списка внизу. Коды инструментов указываются через запятую
Классы, в которых запрещено открывать короткие позиции по заданной бумаге	Настройка списка классов, по которым запрещено создание коротких позиций
_ Инструменты	Выбор инструмента, по которому запрещено создание коротких позиций

	_ Все классы	Запрет распространяется на все классы
	_ По списку	Запрет распространяется на классы из списка внизу. Коды классов указываются через запятую