

Раздел 7. Операции брокера

7.1	Просмотр позиций участника биржевых торгов.....	2
7.2	Работа с лимитами клиентов	2
7.3	Субадминистрирование	3
7.4	Маржинальная торговля	6
7.5	Операции над позициями.....	10
7.6	Динамическая корректировка позиций из файла	19
7.7	Операции над лимитами клиентов на срочном рынке	23
7.8	Операции в Режиме переговорных сделок	28
7.9	Операции РЕПО	30
7.10	Ввод заявки	33
7.11	Торговые операции в РПС, РЕПО, РЕПО-М, РЕПО с ЦК и РЕПО ЦБ с корзиной	35
7.12	Маклерская заявка.....	50
7.13	Маклерская стоп-заявка	55
7.14	Участие в аукционах по размещению инструментов	59
7.15	Режим приема клиентских транзакций с подтверждением брокером.....	61
7.16	Работа с неторговыми поручениями	62
7.17	ПРИЛОЖЕНИЕ. Сообщения об ошибках при работе с позициями.....	66

Раздел посвящен операциям брокеров, а также субброкеров, работающих с системой QUIK по управлению позициями и лимитами клиентов, просмотру собственных позиций на бирже, а также операциям в режимах РПС, РЕПО и при размещении инструментов.

7.1 Просмотр позиций участника биржевых торгов

Наблюдение за позициями брокера и выполнение активных операций в системе QUIK аналогично функционалу биржевого терминала участника торгов на Московской Бирже. Таким образом, помимо обслуживания клиентов через систему QUIK, брокер может осуществлять в полном объеме собственные операции, ранее проводимые через рабочее место участника торгов.

Для просмотра позиций используются следующие таблицы (звездочкой (*) отмечены рекомендуемые таблицы):

- «Позиции участника по деньгам» * - просмотр позиций по денежным средствам;
- «Позиции участника по инструментам» - просмотр суммарных позиций по инструментам на всех счетах;
- «Позиции участника по торговым счетам» - просмотр позиций по одному выбранному инструменту на различных счетах;
- «Позиции по инструментам на выбранных счетах» * - просмотр позиций по всем инструментам в разрезе выбранных счетов.

Для отслеживания выполнения маркет-мейкером его обязательств на рынке ценных бумаг используется «Таблица обязательств маркет-мейкеров».

7.2 Работа с лимитами клиентов

Система QUIK позволяет брокеру осуществлять контроль за использованием клиентами денежных средств и инструментов. Функция контроля осуществляется с помощью установки индивидуальных ограничений (лимитов) на количество денежных средств и/или инструментов, доступных для совершения торговых операций.

7.2.1 Понятие остатка и лимита средств клиента

В системе QUIK предусмотрен отдельный контроль собственных и заемных средств для каждого клиента. Доступные средства клиента разделяются на собственные средства (**остаток**) и заемные средства (**лимит**).

1. «Остаток» представляет собой величину собственных средств клиента.
 - «Входящий остаток» равен средствам клиента на текущий день до совершения торговых операций (на начало дня).
 - «Текущий остаток» равен средствам клиента с учетом проведенных сделок.
2. «Лимит» представляет собой максимальную величину заемных средств брокера, доступных клиенту для совершения операций.
 - «Входящий лимит» равен величине заемных средств, доступных клиенту до совершения торговых операций (на начало дня).
 - «Текущий лимит» равен величине заемных средств, доступных клиенту с учетом совершенных сделок.

До совершения каких-либо сделок текущие значения остатков и лимитов равны входящим. В результате сделок изменяются текущие значения, при этом входящие остаются неизменными.

Значения остатков и лимитов клиентов по денежным средствам отображаются в таблице «Позиции по деньгам». Значения остатков и лимитов клиентов по инструментам отображаются в таблице «Позиции по инструментам».

Из таблицы «Клиентский портфель» можно вызвать Сводную таблицу позиций, содержащую одновременно позиции по инструментам и денежным средствам для определенного клиента.

Значения Входящего остатка и Входящего лимита устанавливаются брокером перед началом торговой сессии (см. п. [7.3.1](#)). При необходимости брокер может изменять эти значения в течение торговой сессии вручную (см. п. [7.5](#)) или программно (см. п. [7.6](#)).

7.3 Субадминистрирование

Субадминистрирование - возможность обслуживания клиентов брокера, являющегося клиентом другого брокера (далее - субброкером). Такая возможность предоставляется в виде распределения лимитов субброкера на лимиты его клиентов и контроля их использования.

Для управления позициями клиентов в системе QUIK введена следующая иерархия пользователей:

- «Менеджер фирмы» - имеет возможность установки и изменения позиций для всех пользователей.
- «Субадминистратор» - имеет возможность установки и изменения позиций для определенной группы пользователей.
- «Клиент фирмы» - не имеет возможности установки и изменения позиций. Клиент фирмы может совершать торговые операции в пределах установленных ему доступных средств.

Клиенты фирмы могут выполнять активные транзакции только при условии, что Менеджер их фирмы установил им позиции по денежным средствам и по инструментам. Менеджер фирмы должен устанавливать позиции по денежным средствам и по инструментам каждому клиенту фирмы в начале торгового дня. В течение торговой сессии Менеджер может изменять позиции по любому клиентскому коду.

Менеджер может назначить клиента фирмы Субадминистратором над группой клиентов фирмы. В этом случае Субадминистратор может просматривать позиции этой группы клиентов, а также устанавливать и изменять лимиты для этих клиентов.

В системе QUIK применяются две схемы субадминистрирования, различающиеся по способу контроля размера средств Субадминистратора и приписанных ему клиентов:

- «Классическая» схема субадминистрирования
 - При выставлении позиций общая сумма денег или инструментов в позициях клиентов, приписанных Субадминистратору, не должна превышать позиций, установленных Менеджером фирмы самому Субадминистратору.

- При установке позиций клиентам позиция самого Субадминистратора уменьшается на размер позиции, отданной клиенту.
- При приеме заявки клиента Субадминистратора или самого Субадминистратора сервер QUIK контролирует достаточность средств в пределах остатков и лимитов непосредственно по их кодам клиентов и по их собственным позициям.
- Результаты торговых операций клиентов не отражаются на величине средств Субадминистратора. Размер средств Субадминистратора соответствует нераспределенному остатку средств, выделенных Менеджером фирмы..

- «Новая» схема субадминистрирования

- При выставлении позиций клиентам Субадминистратор может установить их в произвольном объеме, в том числе и таким образом, что общая сумма денег или инструментов в позициях приписанных ему клиентов будет превышать позицию, установленную Менеджером фирмы самому Субадминистратору.
- При установке Субадминистратором позиции для клиента его собственная позиция не изменяется.
- При приеме заявки клиента Субадминистратора она проверяется на достаточность средств как по позиции этого клиента, так и по позиции Субадминистратора.
- В результате торговых операций клиентов происходит изменение величины доступных средств как клиентов, так и Субадминистратора.

Выбор схемы субадминистрирования определяется соглашением брокера, использующего систему QUIK, и Субадминистратора. В отношении одного Субадминистратора может применяться только одна схема субадминистрирования..

В общем случае применение субадминистрирования выглядит следующим образом:

1. Брокер, использующий систему интернет-трейдинга QUIK, открывает другому брокеру (субброкеру) счет, на котором отражаются средства брокера и его клиентов.
2. Брокер назначает в системе QUIK субброкера как пользователя с правами Субадминистратора над группой клиентов субброкера.
3. Для удобства счета клиентов субброкера отображаются, как правило, в формате «NN/MM» либо «NN_MM», где NN - код счета субброкера, MM - код клиента субброкера, например «74/01», «74_02». Код клиента указывается в заявках и сделках клиентов в поле «Код клиента», а также в поле «Комментарий» в виде записи следующего вида: «код_клиента»/«текстовое примечание», например «74/01/sell 5000 rao»..
4. Субадминистратор может просматривать позиции назначенной ему группы клиентов, а также устанавливать и изменять позиции для этих клиентов.
5. Для отражения проведенных сделок в бэк-офисе Субадминистратор может использовать функцию сохранения Таблицы сделок в текстовый файл (пункт меню **Действия / Сохранить в файл все сделки** или аналогичный пункт контекстного меню Таблицы сделок). Данные сохраняются в формате рабочего места Московской Биржи, распознаваемом большинством программ для бэк-офиса. Сделки клиентов идентифицируются по коду клиента, указанному в поле «Код клиента».
6. Для контроля маржинальных позиций клиентов при использовании схемы с контролем текущей стоимости активов (новая схема) Субадминистратор может использовать специальные таблицы «Клиентский портфель» и «Купить/Продать». Также можно применять таблицу «Скрипт», параметры которой могут быть описаны самостоятельно на встроенном языке QPILE. В частности, таким

образом можно осуществлять расчет текущей стоимости активов клиента и его задолженности по маржинальному кредитованию. Подробнее см. Раздел 8, «Алгоритмический язык QPILE». Кроме того, может применяться Специализированное место риск-менеджера «CoLibri».

7.3.1 Процедура установки значений позиций клиентов

Последовательность выполнения операций при установке начальных значений остатков и лимитов:

1. Перед началом торгов Менеджер фирмы назначает остатки и лимиты Субадминистраторам и Клиентам фирмы. Для выполнения операции рекомендуется использовать загрузку позиций из текстового файла (см. п. [7.5.9](#)).
2. После выставления остатков и лимитов Менеджером они становятся видны Клиентам фирмы и Субадминистраторам в Таблицах позиций. У клиентов Субадминистратора в этот момент в Таблицах позиций пусто и выставять заявки они не могут.
3. Субадминистратор назначает остатки и лимиты средств своим клиентам.

ВАЖНО!

1. **Установкой остатка и/или лимита по инструментам прописывается соответствие между кодом клиента и счетом депо, на котором будут отражаться инструменты клиента. Поэтому для возможности совершения торговых операций клиент должен иметь лимит (допускается нулевой) хотя бы по одному инструменту для указания счета, по которому клиенту разрешены торговые операции.**
2. **Если клиенту не заданы остатки и/или лимиты по инструментам, то он не сможет выполнять торговые операции.**
3. **Допускается отрицательное значение входящего остатка средств клиента. Это означает, что на начало дня клиент имеет задолженность перед брокером. При выделении Субадминистратором средств для клиентов значения отрицательных остатков не изменяют величину средств на счете Субадминистратора.**
4. **Возможна ситуация, при которой лимит заемных средств клиента достигает отрицательной величины, например, при исполнении заявки, введенной вне системы QUIK (с биржевого терминала), в объеме, превышающем доступные средства клиента. При этом QUIK не может контролировать достаточность средств, однако позволяет отследить такую ситуацию.**

7.3.2 Автоматическое создание кодов клиентов Субадминистратором

В системе QUIK существует возможность автоматического создания Субадминистраторами произвольных кодов клиентов. Данная функция используется для:

- создания позиций по счетам, находящимся в управлении у Субадминистратора, с целью контроля их состояния средствами системы QUIK;
- контроля операций по счетам Субадминистратора, совершаемых без использования системы QUIK.

Функция включается администратором сервера QUIK. Если используется автоматическое создание кодов, то добавление кода нового клиента в список клиентов Субадминистратора на сервере QUIK не обязательно.

Субадминистратор может задавать позиции для клиентов, коды которых формируются следующим образом - «<код_субадминистратора>/<код_клиента>». Например, если код Субадминистратора «74», значит, он может устанавливать позиции для клиентов с кодами «74/CL1», «74/10345» и т.п., то есть после символа «/» может быть любая символьная строка.

7.4 Маржинальная торговля

Система QUIK поддерживает возможность кредитования клиентов средствами брокера.

Маржинальное кредитование – это кредитование денежными средствами или инструментами под залог текущей стоимости активов клиента (инструментов и/или денежных средств).

В системе QUIK предусмотрены следующие схемы маржинального кредитования операций клиентов:

1. «По дисконтам» - обеспечивает соблюдение единых требований Центрального банка РФ к правилам осуществления брокерской деятельности.

Проверка покупательной способности клиента выполняется в соответствии с требованиями, при выставлении клиентом поручения контролируется запрет на:

- снижение стоимости портфеля ниже скорректированного уровня маржи;
- образование или увеличение короткой позиции при падении рынка на 5% и более;
- образование временно непокрытой позиции по неликвидному инструменту.

Для оценки портфеля клиента могут использоваться как дисконты, заданные брокером, так и дисконты Центрального Контрагента (ЦК), транслируемые в режиме онлайн из ТС Московской Биржи, при этом дисконты ЦК по отдельным инструментам могут быть переопределены по правилам брокера.

2. «МД+» - схема с ограничением покупательной способности при помощи дисконтов по бумагам, валютам и фьючерсам с возможностью неттинга рисков по множествам инструментов.
3. «На открытую позицию» - применяется для лимитирования операций трейдеров компании или банка. В рамках этой схемы могут быть заданы и проконтролированы следующие ограничения на размеры позиций, заданные в деньгах:

- на короткую или длинную позицию по инструменту;
- на суммарный объем коротких или длинных позиций по всем инструментам;
- на суммарный объем всех позиций — коротких и длинных по инструментам и деньгам;
- на оборот операций за торговую сессию.

4. «По плечу» - при использовании данной схемы максимальный размер заемных средств (маржинальный лимит) рассчитывается исходя из стоимости средств клиента и заданного коэффициента кредитования («плеча»).
5. «По лимитам» - маржинальное кредитование реализовано в виде назначения брокером значений (лимитов) доступных клиенту заемных средств. Если значения лимитов равны нулю, то заемные средства клиенту не предоставляются.

При получении заявок от клиентов на покупку/продажу инструментов блокируются доступные средства клиента в размере, необходимом для исполнения заявки. При этом сначала используются собственные средства (**Текущий остаток**), и при их недостаточности для выполнения заявки используются заемные средства брокера (**Текущий лимит**). При недостаточности доступных средств клиента для исполнения поручения клиента, заявка отвергается системой.

1. **Значения лимитов заемных средств устанавливаются индивидуально для каждого клиента.**
2. **Установкой лимитов по инструментам брокер может регулировать список инструментов, по которым клиент может совершать «короткие продажи», а также их максимальную величину.**
3. **Список инструментов, разрешенных для покупки на заемные денежные средства, может ограничиваться администратором сервера QUIK.**
4. **При распределении лимитов заемных средств по какому-либо инструменту стоит учитывать, что сумма значений «Текущих лимитов» может превышать величину средств брокера в торговой системе и клиентские заявки, принятые системой QUIK, могут быть отвергнуты торговой системой биржи из-за недостаточности средств для их выполнения.**
5. **В течение торгов брокер может менять значения «Входящих лимитов» вручную либо используя механизм Динамической корректировки позиций из файла.**

7.4.1 Управление маржинальной торговлей

Для просмотра и контроля параметров маржинального кредитования и объема доступных средств, а также для открытия длинных и коротких позиций в QUIK предусмотрены следующие таблицы:

- **Клиентский портфель** — параметрами данной таблицы являются: стоимость портфеля клиента, минимальная, начальная, скорректированная маржа, уровень достаточности средств, уровень маржи, использованное «плечо», денежная оценка активов, доступных для открытия позиций по маржинальным и не маржинальным инструментам, а также собственных активов клиента и задолженности брокеру. Набор отображаемых параметров зависит от выбранной схемы маржинального кредитования. В таблице отображается информация по всем доступным пользователю кодам клиентов, например, брокер, либо субброкер может просматривать данные по всем своим клиентам.
- **Купить/Продать** — текущий размер позиции по инструментам и денежная оценка стоимости позиции по каждому инструменту в портфеле клиента, доступный объем инструментов для открытия длинных и коротких позиций. При использовании схемы маржинального кредитования «по

дисконтам» в данной таблице отображаются также дисконты, которые используются при расчете маржинальных показателей.

- **Состояние счета** — таблица предназначена для онлайн мониторинга собственной позиции по деньгам и инструментам. Функционал таблицы позволяет пользователю закрывать и «переворачивать» как выбранные, так и все доступные позиции.

7.4.2 Установка значения лимита по размеру плеча

Окно вызывается выбором пункта «Установить лимит» в меню Действия или контекстном меню таблицы «Клиентский портфель».

Операция предназначена для вычисления значения Входящего лимита на основе оценки стоимости собственных средств клиента и заданной величины «Плеча».

Выбор параметров клиента производится аналогично установке «Позиции по денежным средствам». При вводе в поле «Плечо» соотношения собственных и заемных средств, в поле «Лимит» вычисляется соответствующий размер заемных средств.

Нажатием кнопки «Установить» окно закрывается, и новое значение лимита отображается в таблице «Клиентский портфель». Кнопка «Отмена» закрывает окно без сохранения изменений.

7.4.3 Установка значений лимитов для всех клиентов в таблице

Окно вызывается выбором пункта «Установить лимиты для клиентов из таблицы» в меню Действия или контекстном меню таблицы «Клиентский портфель».

Операция предназначена для установки значения «Входящего лимита» для всех клиентов, отображаемых в окне «Клиентский портфель». Вычисление «Входящего лимита» производится на основе оценки стоимости собственных средств клиента и заданной величины «Плеча».

Для расчета значений «Входящих лимитов» необходимо указать параметры:

- «Код валюты» - выбрать из списка код валюты расчетов;
- «Код позиции» - выбрать из списка код позиции;
- «Срок расчётов» - выбрать из списка срок расчётов. В выпадающем списке отображаются сроки расчётов, доступные для фирмы клиента, выбранного в таблице.
- «Плечо» - ввести соотношение собственных и заемных средств.

Установка флажков «Устанавливать лимиты для» позволяет рассчитывать значения «Входящих лимитов» отдельно для маржинальных и/или немаржинальных клиентов.

7.4.4 Установка значений остатка и плеча

Окно вызывается выбором пункта «Установить остаток и плечо» в меню **Действия** или контекстном меню таблицы «Клиентский портфель».

Операция предназначена для ввода либо изменения значения «Входящего остатка» по денежным средствам и «Плеча». Выбор параметров клиента производится аналогично установке «Позиции по денежным средствам».

Нажатием кнопки «Установить» окно закрывается и введенное значение «Плеча» отображается в таблице «Клиентский портфель», а значение «Позиции клиента» отображается в таблице «Позиции по деньгам» в виде «Входящего остатка». Кнопка «Отмена» закрывает окно без сохранения изменений.

7.4.5 Установка значений остатка и плеча для всех клиентов в таблице

Окно вызывается выбором пункта «Установить плечо для клиентов из таблицы» в меню Действия или контекстном меню таблицы «Клиентский портфель».

Операция предназначена для установки значений Плеча для всех клиентов, отображаемых в окне «Клиентский портфель».

Для установки значения необходимо указать параметры:

- «Плечо» - ввести соотношение собственных и заемных средств,
- «Код валюты» - выбрать из списка код валюты расчетов,
- «Код позиции» - выбрать из списка код позиции,
- «Срок расчётов» - выбрать из списка срок расчётов. В выпадающем списке отображаются сроки расчётов, доступные для фирмы клиента, выбранного в таблице.

Установка флажков «Устанавливать лимиты для» позволяет рассчитывать значения «Плеча» отдельно для маржинальных и/или немаржинальных клиентов.

7.5 Операции над позициями

7.5.1 Создание позиции по денежным средствам

Открытие окна «Установка позиции по денежным средствам» осуществляется выбором в таблице «Позиции по деньгам» пункта контекстного меню «Задать позицию по денежным средствам» или пункта меню Действия/Задать позицию по денежным средствам.

Значение параметров:

1. «Доступные фирмы» - список идентификаторов участников торгов. Идентификаторы различны для разных режимов торгов или бирж. Необходимо выбрать код участника, соответствующий режиму торгов, на который назначается позиция.
2. «Код валюты» - код валюты расчетов:
 - «SUR» - рубли РФ;
 - «USD» - доллары США.
3. «Код позиции» - идентификатор торговой сессии (режима торгов), в которой ведется позиция, например, «EQTV» - Фондовая Московская Биржа.
4. «Код клиента» - код клиента, которому назначается позиция.
5. «Срок расчётов» - срок проведения расчётов. В выпадающем списке отображаются сроки расчётов, заданные в настройках Библиотеки расчета лимитов для указанного кода клиента. Значение «Тх» соответствует позиции клиента после совершения всех расчетов.
6. «Позиция клиента» - значение собственных денежных средств клиента с точностью выбранной валюты.
7. «Лимит клиента» - максимальное значение заемных денежных средств с точностью выбранной валюты.

Назначенная позиция для нового клиента появится в таблице «Позиции по деньгам» в виде новой строки.

7.5.2 Создание позиции по инструментам

Открытие окна «Установка позиции по инструментам» осуществляется выбором в таблице «Позиции по инструментам» пункта контекстного меню «Задать позиции по инструментам» или пункта меню Действия/Задать позиции по инструментам.

Значение параметров:

1. «Инструмент» - наименование инструмента, по которому задается позиция. Выберите нужный инструмент из списка.
2. «Доступные фирмы» - список идентификаторов участников торгов. Идентификаторы различны для разных режимов торгов или бирж. Необходимо выбрать код участника, соответствующий режиму торгов, на который назначается позиция.
3. «Счет депо» - код счета депо в торговой системе биржи для отражения приобретаемых инструментов. Выберите из списка код, соответствующий данному режиму торгов.
4. «Код клиента» - код клиента, которому назначается позиция.
5. «Срок расчётов» - срок проведения расчётов. В выпадающем списке отображаются сроки расчётов, заданные в настройках Библиотеки расчета лимитов для указанного кода клиента. Значение «Тх» соответствует позиции клиента после совершения всех расчетов.
6. «Позиция клиента» - значение собственных средств клиента по данному инструменту, в лотах.
7. «Лимит клиента» - максимальное значение заемных средств клиента по данному инструменту, в лотах.
8. «Цена приобретения» - значение средневзвешенной цены позиции клиента по инструментам.

Если цена приобретения больше нуля, то изменение ее на «0» при редактировании позиции не даст результатов, значение останется прежним.

После того, как назначена позиция для нового клиента, она появится в таблице «Позиции по инструментам» в виде новой строки.

7.5.3 Изменение позиций

Изменение значений позиций клиента вручную выполняется:

- двойным щелчком левой кнопки мыши на соответствующей строке таблицы позиций;
- выбором пункта контекстного меню «Задать позицию по денежным средствам» (или «Задать позиции по инструментам») на соответствующей строке таблицы позиций.
- выбором пункта меню программы Действия/Задать позицию по денежным средствам (или Действия/Задать позиции по инструментам) в соответствующей активной таблице позиций.

7.5.4 Удаление позиции

Удаление позиции для выбранного клиента вручную выполняется:

- двойным щелчком правой кнопки мыши на соответствующей строке таблицы позиций;
- выбором пункта контекстного меню «Удалить позицию по денежным средствам» (или «Удалить позиции по инструментам») на соответствующей строке таблицы позиций;
- выбором пункта меню программы **Действия/Удалить позиции по инструментам** (или **Действия/Удалить позицию по денежным средствам**) в соответствующей активной таблице позиций.

7.5.5 Удаление группы позиций по денежным средствам

меню Брокер / Удалить все позиции по ден. средствам

Функция позволяет удалить группу позиций, удовлетворяющих заданным условиям.

1. «Доступные фирмы» - в приведенном списке выберите идентификатор участника торгов, соответствующий режиму торгов, в котором удаляются позиции.
2. «Удалить все позиции фирмы» - при установленном флажке удаляются все позиции, соответствующие выбранному идентификатору участника торгов. При снятом флажке возможна более гибкая настройка условий.
3. «Валюта» - выбор валюты, в которой выражены денежные средства. Чтобы удалить позиции во всех валютах, установите флажок «все валюты».
4. «Код позиции» - выбор идентификатора торговой сессии (режима торгов), соответствующего удаляемым позициям. Например, «EQTV» - Фондовая Московская Биржа. Позволяет удалить позиции всех клиентов по заданному рынку. При установленном флажке «все коды позиций» удаляются позиции вне зависимости от указанного в них идентификатора торговой сессии.
5. «Код клиента» - поле предназначено для указания кода клиента для удаления позиций определенного пользователя. Код клиента указывается вручную (список отсутствует). Если установлен флажок «все клиенты», то позиции удаляются независимо от значения кода клиента.

Нажатием кнопки «Удалить» выполняется удаление позиций, нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без совершения действий с позициями.

Удаление лимитов по срочному рынку таким способом невозможно.

7.5.6 Удаление группы позиций по инструментам

меню Брокер / Удалить все позиции по инструментам...

Функция позволяет удалить группу позиций, удовлетворяющих заданным условиям.

1. «Доступные фирмы» - в приведенном списке выберите идентификатор участника торгов, соответствующий режиму торгов, в котором удаляются позиции.
2. «Удалить все позиции фирмы» - при установленном флажке удаляются все позиции, соответствующие выбранному идентификатору участника торгов. При снятом флажке возможна более гибкая настройка условий.
3. «Инструмент» - выбор инструмента. Предназначен для удаления позиций клиентов по определенному инструменту. При установленном флажке «все инструменты» удаляются позиции по всем инструментам.
4. «Счета депо» - выбор счета депо для удаления позиций. Если флажок «все счета» установлен, то условие не проверяется.
5. «Код клиента» - поле предназначено для указания кода клиента для удаления позиций определенного пользователя. Код клиента указывается вручную (список отсутствует). Если установлен флажок «все клиенты», то позиции удаляются независимо от значения кода клиента.

Нажатием кнопки «Удалить» выполняется удаление позиций, нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без совершения действий с позициями.

7.5.7 Отчет по позициям

меню Брокер / Отчет по позициям...

Отчет по позициям предназначен для получения информации о действиях с позициями определенного клиента за указанный день: время установки/изменения, присвоенные значения, автор изменений, а также о динамических корректировках позиций, в том числе программой «CoLibri».

Функция запроса отчета доступна пользователям с правами Субадминистратора или Менеджера фирмы.

Назначение полей окна запроса:

- «Заказать отчет по» - выбор действий над позициями, включаемыми в отчет;
- «Код фирмы» - код торгового счета, к которому относится позиция;
- «Код клиента» - код клиента для отчета, каждый отчет составляется только по одному коду;

- «За дату» - выбор даты торгов для отчета.

Результат выполнения отчета показывается в отдельном окне следующего вида:

Отчет по позициям

Дата отчета: 2018.11.13

Код фирмы: NS0038900000

Лимиты по денежным средствам:

Нет данных для отчета

Корректировки лимитов по денежным средствам:

Нет данных для отчета

Лимиты по инструментам:

Тип операции	Время операции	Вид лимита	Клиент	Инструмент	Счет	Входящий остаток	Входящий лимит	Цена приобретения	Пользователь
Установка	10:55:13	T2	Q1	LKOH	L01-00000F00	6919.0000	0.0000	3294.5407	
Установка	10:55:13	T1	Q1	LKOH	L01-00000F00	6919.0000	0.0000	3294.5407	
Установка	10:55:13	T2	Q1	GAZP	L01-00000F00	-10.0000	-0.0000	154.7100	
Установка	10:55:13	T1	Q1	GAZP	L01-00000F00	-10.0000	-0.0000	154.7100	
Установка	10:55:13	T0	Q1	GAZP	L01-00000F00	-10.0000	-0.0000	154.7100	
Установка	10:55:13	T0	Q1	LKOH	L01-00000F00	6919.0000	-0.0000	3294.5407	
Установка	10:55:13	T2	Q1	LKOH	S01-00000F00	-4.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T1	Q1	LKOH	S01-00000F00	-4.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T0	Q1	LKOH	S01-00000F00	-4.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T2	Q1	MSNG	L01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T1	Q1	MSNG	L01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T0	Q1	MSNG	L01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T2	Q1	MSNG	S01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T1	Q1	MSNG	S01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	
Установка	10:55:13	T0	Q1	MSNG	S01-00000F00	-0.0000	-0.0000	0.0000	

Корректировки лимитов по инструментам:

Результаты разных запросов отображаются в разных окнах.

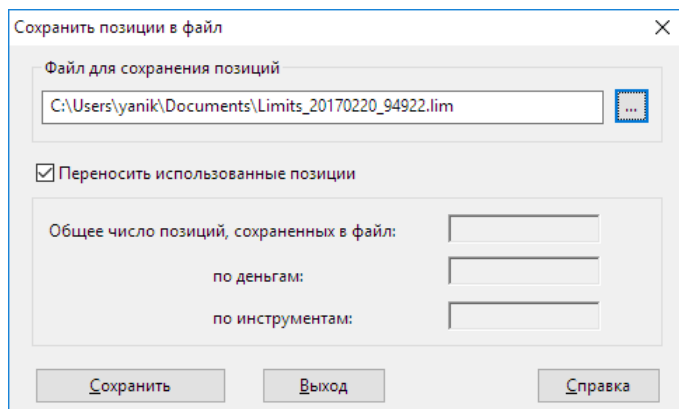
Действия над отчетом, доступные из контекстного меню:

- «Печать» - распечатать отчет на принтере;
- «Предварительный просмотр» - открыть окно просмотра печатного варианта отчета;
- «Сохранить в файл» - сохранить отчет в виде HTML-файла.

7.5.8 Сохранение позиций в файл

меню Брокер / Сохранить позиции в файл...

Функция выполняется через пункт контекстного меню «Сохранить все позиции в файл» в одной из таблиц позиций или из меню программы **Действия**. В открывшемся окне необходимо указать либо выбрать имя файла для записи. В диалоге также приведены информационные поля с указанием количества строк, сохраненных в файле.



Одной операцией сохранения в файл записываются позиции как по инструментам, так и по денежным средствам.

Схемы переноса позиций

1. Если флажок «Переносить использованные позиции» снят, то в файле сохраняются текущие значения остатка и лимита. Таким образом, при последующей загрузке позиций на следующий день входящим (начальным) значениям остатков и лимитов будут присвоены текущие (последние) значения предыдущего дня.

```
OPEN_BALANCE = Текущий остаток
OPEN_LIMIT = Текущий лимит
```

Параметр CURRENT_LIMIT не используется.

2. Если установлен флажок «Переносить использованные позиции», то в файле сохраняются входящее и текущее значения лимита и текущее значение остатка.

```
OPEN_BALANCE = Текущий остаток
OPEN_LIMIT = Входящий лимит
CURRENT_LIMIT = Текущий лимит
```

Параметр CURRENT_LIMIT используется, если Текущий лимит строго меньше входящего.

Нажатием кнопки «Сохранить» производится запись в файл. Нажатие кнопки «Выход» приводит к закрытию окна.

Файл представляет последовательность строк, каждая из которых содержит данные по отдельной позиции, в виде «название параметра»=«значение», разделенные символом «;» через пробел. Последовательность параметров и их значения приведены в таблице.

Параметр	Соответствующее поле таблицы позиций
----------	--------------------------------------

Позиции по деньгам	
--------------------	--

Параметр	Соответствующее поле таблицы позиций
MONEY:	Обозначение записи, относящейся к позиции по денежным средствам
FIRM_ID	Фирма
TAG	Код позиции
CURR_CODE	Код валюты расчетов
CLIENT_CODE	Код клиента
OPEN_BALANCE	Входящий остаток
* OPEN_LIMIT	Входящий лимит
* CURRENT_LIMIT	Текущий лимит
* LEVERAGE	** Плечо
LIMIT_KIND	Срок расчётов

Позиции по инструментам

DEPO:	Обозначение записи, относящейся к позиции по инструментам
FIRM_ID	Фирма
SECCODE	Код инструмента
CLIENT_CODE	Код клиента
OPEN_BALANCE	Входящий остаток
OPEN_LIMIT	Входящий лимит
* CURRENT_LIMIT	Текущий лимит
TRDACCID	Счет депо
WA_POSITION_PRICE	Цена приобретения
LIMIT_KIND	Срок расчётов

* - необязательный параметр

** - параметр таблицы «Клиентский портфель»

Пример файла:

```
MONEY: FIRM_ID = NC0080000000; TAG = EQTV; CURR_CODE = SUR; CLIENT_CODE = 583;
OPEN_BALANCE = 200000,00; OPEN_LIMIT = 0,00; LEVERAGE = -1; LIMIT_KIND = 1;
DEPO: FIRM_ID = NC0080000000; SECCODE = RU0008926621; CLIENT_CODE = 583; OPEN_BALANCE
= 300; OPEN_LIMIT = 0; TRDACCID = NL00800000043; WA_POSITION PRICE = 41,17; LIMIT_KIND
= 0;
```

Результат операции записи в файл отображается в окне сообщений вида:

```
Файл D:\74.lim обработано строк - 210, позиций записано:  
по денежным средствам - 83,  
по инструментам - 127
```

7.5.9 Загрузка позиций из файла

меню Брокер / Загрузить позиции из файла...

Функция может выполняться через пункт контекстного меню «Загрузить позиции из файла» в одной из таблиц позиций или из меню программы **Действия**. В открывшемся окне выберите файл с позициями для загрузки.

В одном файле содержатся позиции как по инструментам, так и по денежным средствам. При описании позиций все параметры являются обязательными, кроме «CURRENT_LIMIT», «LIMIT_KIND» и «LEVERAGE».

Поведение системы при загрузке из файла ранее сохраненных позиций:

1. Если в таблице позиций уже существует позиция для данного клиента, то он изменяется, если позиции нет, то формируется новая строка.
2. Изменение позиций осуществляется следующим образом:

- «Текущий остаток» = («OPEN_BALANCE» - «Входящий остаток») + «Текущий остаток *»
- «Входящий остаток» = «OPEN_BALANCE»
- Если задан «CURRENT_LIMIT», то «Текущий лимит» = «CURRENT_LIMIT»,
иначе «Текущий лимит» = («OPEN_LIMIT» - «Входящий лимит») + «Текущий лимит *»
- «Входящий лимит» = «OPEN_LIMIT»

Где **Текущий остаток *** и **Текущий лимит *** - текущие значения до изменения позиций.

3. Если в файле позиций параметр «LEVERAGE» задан равным -1 или отсутствует, то величина «плеча» вычисляется исходя из величины «Входящего лимита по денежным средствам». Если параметр «LEVERAGE» содержит положительное значение, то величина «плеча» устанавливается явным образом.
4. Если в файле позиций параметр «LIMIT_KIND» отсутствует, то его значение берется равным «0».
5. В случае обнаружения ошибки в какой-либо строке при загрузке файла позиций программа выдаст сообщение следующего вида:

```
Ошибка в строке <номер строки> загружаемого файла <наименование файла>. Параметр  
<наименование параметра> имеет недопустимое значение <значение параметра>
```

7.6 Динамическая корректировка позиций из файла

меню Брокер / Корректировать позиции через файл...

Функция может выполняться через пункт контекстного меню «Корректировать через файл» в одной из Таблиц позиций или из меню программы Действия.

Стандартный механизм расчета позиций подразумевает следующую схему: при совершении сделки пользователем сервер QUIK автоматически рассчитывает позицию по деньгам для этого пользователя в соответствии с настройками сервера QUIK для конкретного рынка. В некоторых случаях эта схема может не удовлетворять. Так как политика предоставления скидок для клиентов и управления маржинальным кредитованием различается во всех фирмах, система предоставляет возможность через специальный интерфейс изменять позиции для клиента динамически.

Динамическая корректировка позиций из файла предназначена для расчета изменений позиций клиентов внешними программными средствами на основе алгоритмов, принятых у брокера.

Применение динамической корректировки позиций из файла позволяет корректировать значения всех (и «Входящих» и «Текущих») остатков и лимитов клиентов, по инструментам и денежным средствам.

7.6.1 Применение динамической корректировки позиций из файла:

1. Пользователь с правами Менеджера фирмы либо Субадминистратора экспортирует необходимые для расчета позиций данные из таблиц QUIK по DDE (в MS Excel) либо через ODBC в базу данных (подробнее о настройке экспорта см. Раздел 6).
2. Средствами MS Excel (например, макросом на языке VBA) либо собственной программой отслеживается изменение параметров и вычисляется изменение позиций на основании алгоритмов, используемых брокером.
3. Поручение на изменение позиции записывается новой строкой в исходный файл со стандартным расширением .lci, например, limits.lci, с присвоением ему уникального параметра «LIMIT_ID».
4. Указанный файл считывается системой QUIK через установленные интервалы времени и при появлении в нем новых строк (имеющих ранее не обрабатывавшиеся значения параметра «LIMIT_ID») формируется команда серверу QUIK на изменение соответствующей позиции.
5. Факт отправки коррекции позиции отражается в выходном файле (*.lco), который может использоваться для диагностики результата операции.
6. Для внешней программы коррекция считается обработанной, если в выходном файле существует строка с параметром «LIMIT_ID», аналогичным значению этого параметра, указанного в коррекции.

7.6.2 Формат исходного файла с корректировками позиций (*.lci)

Каждая строка файла представляет собой набор параметров, записанных в виде «наименование параметра»=«значение параметра», разделенных символом «;» через пробел.

Параметр	Назначение
LIMIT_TYPE	Тип изменяемой позиции. Возможные значения: «MONEY» - позиция по денежным средствам, «DEPO» - позиция по инструментам
LIMIT_ID	Идентификатор корректировки позиции, уникальный целочисленный параметр в интервале от 0 до 2147483648
FIRM_ID	Код участника торгов. Соответствует параметру «Фирма» Таблицы позиций
CLIENT_CODE	Код клиента. Максимум 12 символов. Обязательный параметр
OPEN_BALANCE	Изменение значения «Входящего остатка», необязательный параметр
OPEN_LIMIT	Изменение значения «Входящего лимита», необязательный параметр
CURRENT_BALANCE	Изменение значения «Текущего остатка», необязательный параметр
CURRENT_LIMIT	Изменение значения «Текущего лимита», необязательный параметр
LIMIT_OPERATION	Способ коррекции позиции, обязательный параметр. Возможные значения: 1. «CORRECT_LIMIT» (по умолчанию) - значения позиций изменяются на величину, указанную в корректировках: — «Входящий остаток» = «Входящий остаток»+OPEN_BALANCE — «Входящий лимит» = «Входящий лимит»+OPEN_LIMIT — «Текущий остаток» = «Текущий остаток»+OPEN_BALANCE+CURRENT_BALANCE — «Текущий лимит» = «Текущий лимит»+OPEN_LIMIT+CURRENT_LIMIT 2. «SET_LIMIT» - значения позиций заменяются на указанные в корректировках. — «Входящий остаток» = OPEN_BALANCE — «Входящий лимит» = OPEN_LIMIT — «Текущий остаток» = CURRENT_BALANCE — «Текущий лимит» = CURRENT_LIMIT
* TRDACCID	Номер счета депо, обязательный параметр. Соответствует полю «Счет депо» таблицы «Позиции по инструментам»
* SECCODE	Код инструмента, обязательный параметр. Соответствует полю «Код инструмента» таблицы «Позиции по инструментам»
** TAG	Код позиции, обязательный параметр. Соответствует полю «Код позиции» таблицы «Позиции по деньгам»
** CURR_CODE	Код валюты, обязательный параметр. Соответствует полю «Валюта» таблицы «Позиции по деньгам»
LIMIT_KIND	Срок расчётов. Соответствует полю «Срок расчётов» таблиц «Позиции по деньгам» и «Позиции по инструментам»
** LEVERAGE	Плечо, необязательный параметр. Соответствует полю «Плечо» таблицы «Позиции по деньгам»
* WA_POSITION_PRICE	Средневзвешенная цена приобретения, необязательный параметр. Соответствует полю «Цена приобретения» таблицы «Позиции по инструментам»

* - параметр корректировки позиций по инструментам (LIMIT_TYPE=DEPO)

** - параметр корректировки позиций по денежным средствам (LIMIT_TYPE=MONEY)



Несмотря на то, что параметры «OPEN_BALANCE», «OPEN_LIMIT», «CURRENT_BALANCE», «CURRENT_LIMIT» являются необязательными, по крайней мере один из них должен быть задан для каждой коррекции позиций.

Примеры строк:

- коррективировка позиции по денежным средствам

```
LIMIT_TYPE=MONEY; LIMIT_ID=1; FIRM_ID=NC0038900000; TAG=EQTV; CURR_CODE=SUR;  
CLIENT_CODE= SUBADM1; OPEN_LIMIT=10; CURRENT_LIMIT= 10;  
LIMIT_OPERATION=CORRECT_LIMIT; LIMIT_KIND=1; LEVERAGE=0,2;
```

- установка позиции по денежным средствам

```
LIMIT_TYPE=MONEY; LIMIT_ID=2; FIRM_ID=NC0038900000; TAG=EQTV; CURR_CODE=SUR;  
CLIENT_CODE= SUBADM2; OPEN_LIMIT=10000; CURRENT_LIMIT=5000;  
LIMIT_OPERATION=SET_LIMIT; LIMIT_KIND=0; LEVERAGE=0,18;
```

- коррективировка позиции по инструментам

```
LIMIT_TYPE=DEPO; LIMIT_ID=3; FIRM_ID=NC0038900000; SECCODE=RU0008926621;  
TRDACCID=L01-00000F00; CLIENT_CODE=CL2; OPEN_LIMIT=1; CURRENT_LIMIT=0;  
OPEN_BALANCE=10; CURRENT_BALANCE= -2; LIMIT_OPERATION=CORRECT_LIMIT; LIMIT_KIND=2;  
WA_POSITION_PRICE=2;
```

- установка позиции по инструментам

```
LIMIT_TYPE=DEPO; LIMIT_ID=4; FIRM_ID=NC0038900000; SECCODE=RU0009024277;  
TRDACCID=L01-00000F00; CLIENT_CODE= CL3; OPEN_LIMIT=200; CURRENT_LIMIT=100;  
OPEN_BALANCE=500; CURRENT_BALANCE=400; LIMIT_OPERATION=SET_LIMIT; LIMIT_KIND=0;
```

7.6.3 Формат выходного файла с результатами корректировок (*.lco)

Каждая строка файла представляет собой набор параметров, записанных в виде «наименование параметра»=«значение параметра», разделенных символом «;» через пробел.

Параметр	Назначение
LIMIT_TYPE	Тип изменяемой позиции. Возможные значения: «MONEY» - позиция по денежным средствам, «DEPO» - позиция по инструментам
LIMIT_ID	Идентификатор корректировки позиции. Соответствует значению, указанному в файле с корректировками позиций (*.lci)
STATUS	Результат обработки корректировки позиций. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> — «-2» - коррекция позиции не соответствует заданному формату, — «0» - коррекция позиции отправлена серверу QUIK, — «1» - коррекция позиции успешно выполнена на сервере QUIK, — «2» - коррекция позиции отклонена сервером QUIK
DESCRIPTION	Текстовый комментарий результата обработки корректировки позиций

Примеры строк:

```
LIMIT_ID=30;LIMIT_TYPE=MONEY;STATUS=0;DESCRIPTION=Коррекция отправлена на сервер;
LIMIT_ID=30; LIMIT_TYPE=MONEY; STATUS=1; DESCRIPTION=Коррекция успешно проведена;
```

7.6.4 Настройка динамической корректировки позиций из файла

Настройка осуществляется одним из следующих способов:

- Выбором пункта меню программы **Брокер / Корректировать позиции через файл...**;
- Выбором контекстного меню «Корректировать через файл» в одной из Таблиц позиций или из меню программы **Действия**.

Динамическая загрузка корректировок позиций из файла

Файл с исходными данными о корректировках позиций
D:\Temp\lim\lkoh eng kor.lci ... Очистить

Обрабатывать через 5 секунд
☐ Оповещать об обработке файла звуковым сигналом

Файл с данными об успешно отправленных корректировках позиций
D:\Temp\lim\lkoh eng kor.lco ... Очистить

Файл с журналом отправляемых корректировок позиций
... Очистить

☐ Вести журнал отправляемых корректировок позиций

Число обращений, сделанных к файлу: 0
Число прочитанных из файла строк: 0
Число отправленных корректировок позиций: 0
Всего отправлено корректировок позиций: 0
Всего выполнено корректировок позиций: 0

Начать обработку Прекратить обработку

Закрыть Справка

1. «Файл с исходными данными о коррекциях позиций» - укажите путь к файлу с корректировками позиций (*.lci).
2. «Обрабатывать через ... секунд» - интервал обращения системы QUIK к текстовому файлу.
3. «Оповещать об обработке файла звуковым сигналом» - при установленном флажке обращение к тестовому файлу сопровождается звуковым сигналом.
4. «Файл с данными об успешно отправленных коррекциях позиций» - укажите путь к файлу с результатами корректировки позиций (*.lco).
5. «Файл с журналом отправляемых коррекций позиций» - укажите путь к файлу с журналом действий программы по корректировке позиций (*.lcr).
6. «Вести журнал отправляемых коррекций позиций» - при установленном флажке действия программы по корректировке позиций протоколируются в файл с журналом, указанным выше. При снятом флажке протоколирование прекращается.
7. Нажатие кнопки «Начать обработку» приводит к запуску процедуры динамической корректировки позиций. Окно настройки при этом остается открытым и может быть убрано с экрана нажатием кнопки «Закрыть».
8. Нажатие кнопки «Прекратить обработку» останавливает процесс корректировки позиций.
9. Для контроля за обращением программы к файлу с корректировками позиций предназначены следующие информационные поля окна:
 - «Число обращений, сделанных к файлу» - количество обращений к текстовому файлу с момента запуска процесса. При прекращении обработки значение фиксируется, при повторном запуске устанавливается нулевое значение.
 - «Число прочитанных из файла строк» - количество строк, прочитанных из файла при последнем обращении к нему.
 - «Число отправленных коррекций позиций» - количество команд серверу на корректировку позиций, сформированных в результате последнего обращения к файлу. Значение может отличаться от числа прочитанных строк, если были обнаружены ошибки или какая-либо корректировка для какой-либо транзакции уже была передана серверу.
 - «Всего отправлено коррекций позиций» - количество команд серверу на корректировку позиций, переданных с момента запуска процесса.
 - «Всего выполнено коррекций позиций» - количество исполненных команд серверу на корректировку позиций с момента запуска процесса.

7.7 Операции над лимитами клиентов на срочном рынке

7.7.1 Особенности работы с лимитами клиентов на срочном рынке



В отличие от операций на фондовом рынке, функции контроля достаточности средств клиента для совершения операций выполняет не сервер системы QUIK, а непосредственно торговая система биржи.

Создание и редактирование лимитов на срочном рынке осуществляются вводом соответствующей транзакции в торговую систему. Если транзакции недоступны, то операции с лимитами невозможны.

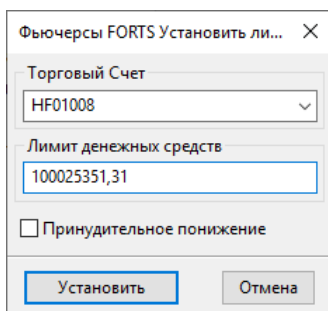
Брокер устанавливает ограничения на счет клиента, отражающие максимальные значения собственных средств, дальнейший контроль параметров осуществляется торговой системой.

7.7.2 Создание лимита

Создать новое ограничение на счет клиента можно одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором класса, относящегося к срочному рынку (например, «Фьючерсы FORTS») и транзакции «Задать лимит»;
- Нажатием кнопки  на панели инструментов (таблица «Ограничения по клиентским счетам» должна быть активна);
- Нажатием клавиши «F2» (таблица «Ограничения по клиентским счетам» должна быть активна);
- Двойным нажатием левой кнопки мыши на строке таблицы «Ограничения по клиентским счетам» (для этого в таблице должен присутствовать хотя бы один лимит клиента);
- Выбором пункта контекстного меню «Задать лимит» в таблице «Ограничения по клиентским счетам».

Значения параметров окна установки лимитов:



Фьючерсы FORTS Установить лимит

Торговый Счет
HF01008

Лимит денежных средств
100025351,31

☐ Принудительное понижение

Установить Отмена

1. «Торговый счет» - номер счета клиента в торговой системе. Значение должно указываться с учетом регистра.
2. «Лимит денежных средств» - для срочного рынка в поле указывается величина денежных средств клиента.
3. «Принудительное понижение» - при установленном флажке в торговую систему подается поручение на принудительное понижение ограничения по денежным средствам клиента до заданного значения, при этом устанавливается значение КГО=0 и включается параметр «Использовать КГО». Если флажок отключен, то КГО не используется и не изменяется. Параметр Секции срочного рынка Московской Биржи.

При использовании стандартной формы ввода существует возможность указания дополнительных параметров и корректировки значения лимита на Срочном рынке FORTS. Для этого необходимо включить в настройках программы (пункт меню **Система/Настройки/Основные настройки...**, раздел «Торговля» / «Заявки» / «Формы ввода») флажок «Применять стандартные формы ввода».

Дополнительные параметры, доступные в окне установки лимитов:

Фьючерсы FORTS Установить лимит

Фирма: QORT_00 [SPBFUT389] Торговый счет: HF01MAIN

Лимит по денежным средствам: 500000

Коэффициент клиентского ГО: 3 Использовать КГО: ☒ Да

Скорректировать лимит: ☐ Да

Автоматическая коррекция лимита: По умолчанию

Проверка лимита на задолженность: ☐ Да

Выполнить Отмена

1. «Коэффициент клиентского ГО» - Дополнительный коэффициент гарантийного обеспечения (ГО), увеличивающий общее портфельное ГО. Указывается в относительных единицах.
2. «Использовать КГО» - признак использования коэффициента клиентского ГО. Если флажок отключен, то корректировка величины портфельного ГО на указанный коэффициент не производится.
3. «Скорректировать лимит». Если флажок выключен, то установкой лимита задается новое абсолютное значение действующего ограничения. Если флажок включен, то действующее значение ограничения будет увеличено на указанное значение лимита.
Если необходимо изменить только значение «Коэффициента клиентского ГО», то в полях с лимитами необходимо указать нулевые значения и включить данный флажок.


7.7.3 Изменение лимита

Изменение ограничения по счету выполняется двойным нажатием левой кнопки мыши на строке с редактируемым значением.

На срочном рынке возможно изменение только входящих значений остатков и лимитов, текущие значения (с учетом сделок) изменяются торговой системой на разницу между новым и старым значением входящего остатка (или лимита).

7.7.4 Удаление лимита

Удалить выбранное ограничение на торговый счет клиента можно одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «CTRL»+«D»;
- Двойным нажатием правой кнопки мыши на удаляемой строке таблицы «Ограничения по клиентским счетам».
- Выбором пункта контекстного меню «Удалить лимит» в таблице «Ограничения по клиентским счетам»;

- Нажатием кнопки **T** на панели инструментов, выбором класса, относящегося к срочному рынку (например, «Фьючерсы FORTS») и транзакции «Удалить лимит», при этом появится диалог следующего вида:

Значения параметров окна:

1. «Фирма» - идентификатор фирмы.
2. «Тип лимита» - выбор типа удаляемого ограничения («Денежные средства»).
3. «Торговый счет» - номер торгового счета для удаления лимита. Значение должно указываться с учетом регистра.

Операция выполняется нажатием кнопки «Выполнить». Результат выполнения операции отображается в «Окне сообщений».

7.7.5 Сохранение в файл лимитов по срочному рынку

меню Брокер / Сохранить лимиты по срочному рынку...

Функция выполняется через пункт контекстного меню «Сохранить лимиты по срочному рынку» в одной из таблиц ограничений или из меню программы **Действия/Сохранить лимиты по срочному рынку**. В открывшемся окне необходимо указать либо выбрать имя файла для записи. В файл сохраняются текущие значения ограничений по клиентским счетам.

Файл представляет последовательность строк, каждая из которых содержит данные по отдельному лимиту, в виде «название параметра»=«значение», разделенные символом «;» без пробелов. Последовательность параметров и их значения приведены в таблице.

Параметр	Назначение
CLASS_CODE	Код класса инструментов. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none"> — «SPBFUT» - Рынок FORTS; — «» (пусто) - в момент сохранения лимитов информации о коде класса не было
ACCOUNT	Торговый счет
VOLUME_MN	Лимит открытых позиций, при «Тип лимита» = «Ден. средства» или «Всего»
KGO	Коэффициент клиентского гарантийного обеспечения
USE_KGO	Параметр, который определяет, будет ли загружаться величина КГО при загрузке лимитов из файла: <ul style="list-style-type: none"> — при USE_KGO=Y - величина КГО загружается — при USE_KGO=N - величина КГО не загружается
FIRM_ID	Идентификатор фирмы / раздела на FORTS, на которой устанавливается лимит

Параметр	Назначение
SECCODE	Код инструмента

Примеры строк:

- Лимиты срочного рынка FORTS:

```
CLASS_CODE=SPBFUT;ACCOUNT=589_001;VOLUMEMN=5551,00;KGO=4,00;
USE_KGO=Y;FIRM_ID=SPBFUT589;
```

1. Функция загрузки из файла доступна только при наличии связи с сервером.
2. Параметр «FIRM_ID» используется в случае загрузки лимитов срочного рынка FORTS на различные разделы с одного терминала.

7.7.6 Загрузка из файла лимитов по срочному рынку

меню Брокер / Загрузить лимиты по срочному рынку...

Функция выполняется через пункт контекстного меню «Загрузить лимиты по срочному рынку» в одной из таблиц ограничений или из меню программы Действия / Загрузить лимиты по срочному рынку. В открывшемся окне укажите следующие параметры:

1. «Файл с исходными данными лимитов по срочному рынку» - выбор файла с лимитами для загрузки.
2. «Ограничить скорость» - при включенном признаке количество транзакций, отправляемых на сервер в секунду, ограничивается значением, указанным в поле «Количество транзакций в секунду». По умолчанию признак выключен.
3. «Число строк, прочитанных из файла» - количество строк, прочитанных из файла с лимитами.
4. «Число отправленных транзакций» - количество транзакций, отправленных на сервер QUIK.

Поведение системы при загрузке из файла ранее сохраненных лимитов:

1. При загрузке из файла устанавливаются входящие значения лимитов. Текущие значения (с учетом сделок) изменяются торговой системой на разницу между новым и старым значением входящего остатка (или лимита).
2. Если строка файла не содержит ошибок, то формируется транзакция на создание лимита клиента. Если лимит для такого клиента уже существует в системе, то производится его изменение.
3. В случае обнаружения ошибки в какой-либо строке при загрузке файла лимитов программа выдаст сообщение следующего вида:

Ошибка в строке <номер строки> загружаемого файла <наименование файла>. Параметр <наименование параметра> имеет недопустимое значение <значение параметра>

7.7.7 Изменение позиции по срочному контракту

Операция предназначена для корректировки размера Входящей чистой позиции для фьючерсных и опционных контрактов. Окно открывается выбором пункта «Установить позицию» контекстного меню таблицы «Позиции по клиентским счетам» и содержит следующие параметры:

1. «Фирма» - идентификатор фирмы-дилера в торговой системе.
2. «Инструмент» - идентификатор инструмента в торговой системе.
3. «Торговый счет» - код торгового счета клиента (с учетом регистра).
4. «Вход. чист. поз.» - корректируемое значение Входящей чистой позиции (общего количества контрактов в открытых позициях на начало торгов).

В общем случае требуется скорректировать только значение Входящей чистой позиции, оставляя неизменными остальные поля в данном окне.

7.8 Операции в Режиме переговорных сделок

Режим переговорных сделок (РПС) - режим сделок без предварительного депонирования средств с отложенной датой исполнения, предусматривающий возможность заключения адресных и безадресных сделок.

В Режиме переговорных сделок предоставляется возможность заключения сделок с отложенной датой исполнения, определяемой выражением: «Т + n», где «Т» - дата заключения сделки, «n» - количество

торговых дней в Торговой системе, через которое должна быть исполнена сделка. Значение «п» принимает от 0 до 30. Для обозначения даты исполнения в Торговой системе используются коды расчетов «T0», «B0»...«B31».

На основе кода расчётов определяется дата исполнения сделки:

Код расчётов	T0	B0	B01	B02	...	B31
Дата исполнения сделки	T	T	T+1	T+2	...	T+31

7.8.1 Адресные и безадресные заявки

Заявки на торги по условиям своего выполнения могут быть адресными и безадресными:

- **Адресная заявка** выражает намерение заключить сделку с определенным партнёром.
- **Безадресная заявка** выражает согласие заключить сделку, адресованное всем участникам торгов.

Безадресная заявка является приглашением делать встречные предложения путём подачи адресной заявки. В соответствии с правилами торгов, первая адресная заявка, посланная в качестве ответа на вашу безадресную заявку с совпадающими условиями, должна быть принята вами. При вводе в торговую систему такой адресной заявки, безадресная заявка, инициировавшая её подачу, покидает таблицу «Котировки для РПС» и Таблицу безадресных внебиржевых заявок.

Адресная заявка, отправленная в ответ на безадресную заявку, в соответствии с правилами торгов должна быть удовлетворена партнёром на предложенных им условиях, оговоренных в безадресной заявке.

Неисполненная адресная заявка, находящаяся в торговой системе, является активной заявкой. Участник может снять активную заявку или изменить некоторые её условия. Заключение сделки на основе активной адресной заявки требует дополнительного согласия (принятия) получившего её участника торгов. В случае её принятия партнером, в торговой системе регистрируется сделка.

7.8.2 Заключение сделок в РПС

Работа в Режиме переговорных сделок предусматривает три этапа:

1. Обмен заявками между участниками торгов. Производится ввод заявок в торговую систему.

Используемые таблицы:

- «Таблица текущих торгов» - совокупная информация о безадресных заявках и исполненных сделках.
- «Таблица обезличенных сделок» - информация об исполненных сделках без указания контрагентов.
- «Таблица безадресных заявок на внебиржевые сделки» - информация о состоянии собственных безадресных заявок, поданных в торговую систему,
- «Таблица заявок на внебиржевые сделки» - информация о состоянии адресных заявок, одной из сторон в которых указан данный Участник торгов (отправленные и полученные),

- «РПС котировки» - отображение очереди безадресных заявок по выбранному инструменту,
- «Таблица участников торгов» - список контрагентов по адресным сделкам.

2. Согласование условий сделок и их заключение. Согласование условий осуществляется путем переговоров и вводом заявок на утвержденных условиях. Заключение сделки осуществляется вводом встречной заявки на условиях, аналогичных заявке контрагента. Информация обо всех совершенных на рынке сделках без указания их контрагентов помещается в Таблицу обезличенных сделок. Используемые таблицы те же.

3. Исполнение заключенных сделок. При наступлении дня исполнения сделки в Таблице сделок для исполнения появляется строка с параметрами собственной заявки, относящейся к сделке. Каждый из контрагентов подтверждает сделку вводом заявки-отчета на исполнение сделки РПС. Сделка считается исполненной после ее подтверждения обоими контрагентами.

Используемые таблицы:

- «Таблица сделок для исполнения» - информация о состоянии подтверждения заключенных сделок с наступившим сроком исполнения,
- «Таблица заявок-отчетов на сделки РПС» - информация об отправленных/принятых отчетах на исполнение сделок.

Расчёты по сделкам, заключённым на основе заявок с кодом расчётов «Т0» проводятся автоматически при достаточности позиций в момент заключения сделок. Эти сделки не попадают в Таблицу сделок для исполнения, и отчеты в Таблице заявок-отчетов на сделки РПС по таким сделкам не формируются.

Сделки, заключённые на основе заявок с кодом расчётов «Z0», включаются в режиме расчетов по правилам простого клиринга.

При совершении сделок в РПС средства на счете участника торгов блокируются при подтверждении им сделок в день исполнения. Списание/зачисление средств осуществляется торговой системой биржи при подтверждении сделки обоими контрагентами.

Если в файле info.ini в секции [transactions] значение настройки «set-for-negdeals-same-operation-as-for-negtrades» равно «1», или данная настройка отсутствует, то при подаче адресной заявки по сделке для исполнения указывается та же операция, что и в исходной сделке для исполнения. Если значение настройки «set-for-negdeals-same-operation-as-for-negtrades» равно «0», то указывается операция, противоположная операции исходной сделки для исполнения.

7.9 Операции РЕПО

Сделка РЕПО, сделка с обратным выкупом – сделка с ценными бумагами, состоящая из двух частей:

- 1. По первой части сделки РЕПО в дату ее заключения продавец ценных бумаг обязан поставить ценные бумаги, а покупатель обязан заплатить денежные средства.**

- 2. В дату исполнения второй части сделки РЕПО покупатель ценных бумаг по первой части сделки РЕПО обязан поставить ценные бумаги, а продавец по первой части сделки РЕПО обязан заплатить денежные средства в соответствии с условиями заключенной сделки РЕПО.**

Фактически, сделка РЕПО представляет собой краткосрочный кредит ценными бумагами, под оговоренный в условиях сделки процент («ставку РЕПО»).

Для операций РЕПО используются коды расчетов - «R01» ... «R90», обозначающие срок исполнения второй части РЕПО. Срок исполнения второй части РЕПО для облигаций не может быть указан позднее даты погашения.

Сделки, заключённые на основе заявок с кодом расчётов «Z0», включаются в режим расчетов по правилам простого клиринга.

7.9.1 Адресные и безадресные заявки РЕПО

Безадресная заявка РЕПО выражает согласие заключить сделку РЕПО на указанных в заявке условиях, направленное всем участникам торгов. Адресная заявка РЕПО выражает намерение заключить сделку РЕПО с определенным партнером на указанных в заявке условиях.

Заключение сделки РЕПО происходит на основе двух встречных адресных заявок с совпадающими условиями.

В отличие от РПС в режиме торгов РЕПО при получении участником торгов встречной адресной заявки с совпадающими условиями к своей безадресной, последняя в торговой системе автоматически не снимается.

7.9.2 Заключение сделок РЕПО

Операции РЕПО предусматривают три этапа:

- 1. Обмен заявками между участниками торгов.** Производится ввод заявок в торговую систему. При получении заявки сервер QUIK блокирует средства пользователя в размере, требуемом для ее исполнения.

Используемые таблицы:

- «Таблица текущих торгов» - совокупная информация о безадресных заявках и исполненных сделках,
- «Таблица обезличенных сделок» - информация об исполненных сделках без указания контрагентов,
- «Таблица безадресных заявок на внебиржевые сделки» - информация о состоянии собственных безадресных заявок, поданных в торговую систему,

- «Таблица заявок на внебиржевые сделки» - информация о состоянии адресных заявок, одной из сторон в которых указан данный Участник торгов (отправленные и полученные),
- «РПС котировки» - отображение очереди безадресных заявок по выбранному инструменту (для котировок РЕПО таблица имеет представление, отличное от котировок РПС),
- «Коды расчетов» - информация по накопленному купонному доходу и ставкам РЕПО на даты, соответствующие кодам расчетов,
- «Таблица участников торгов» - список контрагентов по адресным сделкам.

2. Заключение сделок. Заключение сделки осуществляется вводом встречной адресной заявки на условиях, аналогичных адресной заявке контрагента. Расчеты по сделке осуществляются торговой системой биржи непосредственно при исполнении сделки. Информация обо всех совершенных на рынке сделках без указания их контрагентов помещается в Таблицу обезличенных сделок.

Используемые таблицы те же.

3. Исполнение второй части РЕПО. Начиная со дня, следующего за днем заключения сделки, в Таблице сделок для исполнения появляется заявка с ценой второй части РЕПО, рассчитанной на текущий день. Исполнение второй части РЕПО осуществляется вводом заявки-отчета на исполнение сделки РПС обеими сторонами сделки. Сделки, порождаемые исполнением второй части РЕПО, отражаются также в Таблице обезличенных сделок, без указания сторон сделки.

- 1. Если на счете участника торгов недостаточно средств, ввод заявки-отчета невозможен.**
- 2. Контрагент по сделке РЕПО вправе отказаться от досрочного исполнения второй части РЕПО.**

Используемые таблицы:

- «Таблица сделок для исполнения» - информация о сделках на исполнение второй части РЕПО,
- «Таблица заявок-отчетов на сделки РПС» - информация об отправленных/принятых отчетах на исполнение второй части РЕПО.

7.9.3 Режим модифицированного РЕПО

Система QUIK поддерживает возможность совершения сделок в режиме модифицированного РЕПО (далее - РЕПО-М). Режим модифицированного РЕПО запущен на Московской Бирже и имеет ряд особенностей по сравнению с традиционным РЕПО.

Основные возможности РЕПО-М:

- 1.** Использование дисконта к рыночной цене предыдущего торгового дня при заключении сделок РЕПО (изменение механизма заключения сделки РЕПО);
- 2.** Использование компенсационных взносов (как опциональная возможность) в качестве стандартного биржевого механизма контроля рыночных рисков и снижения рисков неисполнения обязательств;

3. Заключение сделок без контроля обеспечения по первой части РЕПО (код расчетов S0), а так же сделок с исполнением обязательств по первой части РЕПО в отложенный срок - 1-ый или 2-ой день после даты заключения сделки (коды расчетов S1, S2);
4. Заключение сделок РЕПО с возможностью исполнения обязательств по ее второй части на срок до 180 календарных дней.

В режиме модифицированного РЕПО с акциями в 1 лоте содержится 1 акция по всем ценным бумагам. Это приводит к тому, что становится невозможным ведение учета клиентских позиций на этих режимах в лотах. Например, РусГидро в режиме основных торгов имеет размер лота, равный 100 бумаг, а в режиме «РЕПО-М: Акции» один лот РусГидро равен одной бумаге. Если позиция клиента по бумаге задана в лотах, то при подаче заявки на продажу одной бумаги в режиме «РЕПО-М: Акции» сервер QUIK не имеет возможности корректно отразить эту операцию. Выходом из данной ситуации является перевод системы на учет позиций в штуках.

За более подробной информацией по настройке рекомендуем обратиться в Службу технической поддержки QUIK (quiksupport@argatech.com).


7.9.4 Сделки РЕПО с Центральным Контрагентом

Система QUIK поддерживает возможность совершения сделок РЕПО с Центральным Контрагентом на Московской Бирже (далее - РЕПО с ЦК).

РЕПО с ЦК - это вид биржевого РЕПО, при котором контрагентом участника является Центральный Контрагент (ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»). Центральный Контрагент (ЦК) исполняет обязательства перед участниками, независимо от исполнения обязательств перед ЦК. То есть, если два участника заключили между собой сделку РЕПО с ЦК, и один из них не выполнил обязательства перед ЦК, то ЦК перед вторым участником исполнит обязательства в полном объеме в любом случае.

7.10 Ввод заявки

Окно ввода заявки может быть вызвано одним из следующих способов:

- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Двойным нажатием левой кнопки мыши;
- Нажатием клавиши «F2»;
- Выбором в таблице пункта контекстного меню «Новая заявка»;
- Выбором пункта меню Действия/Новая заявка;
- Использованием Общего способа выполнения транзакций с выбором операции «Ввод заявки»;
- Из окна «Графики». Подробнее см. п. 4.1.5 Раздела 4 «Графики».

Ввод заявки возможен в таблицах: Таблица котировок (очередь заявок), Объединенные котировки, Таблица заявок, Таблица сделок, Таблица обезличенных сделок, Таблица текущих торгов, Карман транзакций.

Описание полей окна ввода заявки см. в Разделе 5 «Торговые операции клиента», п. 5.2.
Дополнительно отображается параметр:

1. «Заявка маркет-мейкера» - признак подачи заявки маркет-мейкером.

Признак отображается, если настройка enable-market-maker-fields секции [transactions] файла info.ini равна «1».

Возможна настройка установки признака по умолчанию в файле default_client_codes.ini, имя и путь к которому необходимо указать в файле настроек info.ini в секции [General] в параметре default-clients-file. Пример файла info.ini:

```
[general]
... ..
default-clients-file=D:\Program Files\QUIK\default_client_codes.ini
... ..
```

В отдельных секциях для каждого класса указываются следующие ключи:

- market-maker-orders - признак установки по умолчанию флажка «Заявка маркет-мейкера» для класса инструментов («0» - не установлен, «1» - установлен);
- market-maker-orders-**<Код инструмента>** - признак установки по умолчанию флажка «Заявка маркет-мейкера» для определенного инструмента данного класса («0» - не установлен, «1» - установлен).

Пример:




```
[EQRP]
market-maker-orders=0
market-maker-orders-VTBR=1
```

- 1. Если установлен признак «Применять стандартные формы ввода» в меню Система/Настройки/Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Заявки» / «Формы ввода», то настройки market-maker-orders и market-maker-orders-**<Код инструмента>** в файле default_client_codes.ini игнорируются, и значение признака «Заявка маркет-мейкера» по умолчанию определяется настройками шлюза торговой системы.**
- 2. Если настройки market-maker-orders и market-maker-orders-**<Код инструмента>** в файле default_client_codes.ini не заданы, то значение признака «Заявка маркет-мейкера» по умолчанию определяется настройками шлюза торговой системы. Если перечисленные настройки не заданы, и окно ввода заявки открывается из Таблицы заявок, то значение признака «Заявка маркет-мейкера» берется из выделенной заявки.**

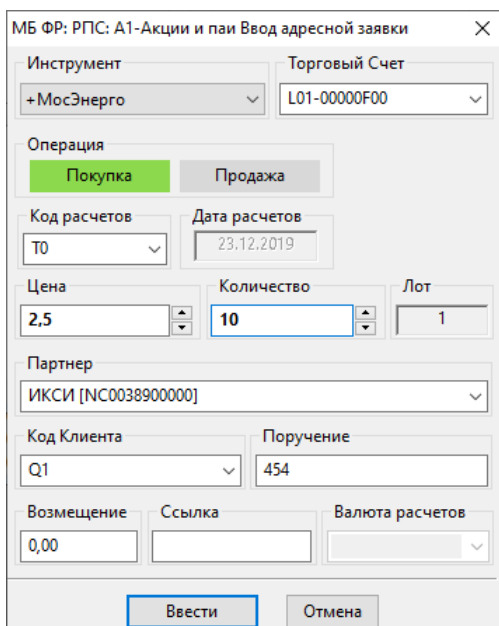
7.11 Торговые операции в РПС, РЕПО, РЕПО-М, РЕПО с ЦК и РЕПО ЦБ с корзиной

7.11.1 Ввод адресной заявки

Окно ввода новой адресной заявки может быть вызвано одним из следующих способов:

1. Общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС Акции 1-го уровня») и операции «Ввод адресной заявки». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».
2. В Таблице заявок на внебиржевые сделки (в таблице должна присутствовать хотя бы одна заявка):
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Выбором пункта контекстного меню «Новая заявка на внебиржевую сделку» или пункта меню программы **Действия/Новая заявка на внебиржевую сделку**;
 - Двойным щелчком левой кнопки мыши на строке с заявкой;
 - Нажатием клавиши «F2».
3. В таблице «РПС котировки» по выбранному инструменту:
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Выбором пункта контекстного меню «Новая заявка» или пункта меню программы **Действия/Новая заявка**;
 - Двойным щелчком левой кнопки мыши на строке с котировкой;
 - Нажатием клавиши «F2».

7.11.2 Заполнение полей окна ввода адресной заявки в режиме РПС



1. «Инструмент» * - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
2. «Торговый счет» * - выберите из списка номер торгового счета, в отношении которого делается поручение.
3. «Операция» * - направление операции: «Покупка» или «Продажа».
4. «Код расчетов» - укажите вручную либо выберите из списка код расчетов по сделке (значения: «Т0», «В0», «В01»..«В30», «Z0»; для валютного рынка: «Т0», «Т1», «F1W», «F2W», «F1M», «F2M», «F3M», «F6M», «F1D-F180D»). Если поле не заполнено, принимается значение по умолчанию: «Т0».
5. «Дата расчетов» - дата расчетов по сделке для указанного инструмента и кода расчетов (информационное поле).
6. «Цена» * - цена заявки, за единицу финансового инструмента. Если в настройках программы выбрано свойство «Подставлять текущую цену в заявку РЕПО», то это поле будет автоматически заполнено ценой последней сделки в основном режиме торгов.
7. «Количество» * - количество инструментов, выраженное в лотах.
8. «Лот» - количество инструментов в одном лоте (для информации).
9. «Партнер» * - выберите из списка либо укажите вручную краткое наименование контрагента по сделке.
10. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
11. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.
12. «Возмещение» - ставка возмещения за просрочку исполнения обязательств по сделке РПС, выраженная в процентах.
13. «Ссылка» - текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Если один из контрагентов указал что-либо в этом поле, то другой контрагент обязан ввести то же самое.
14. «Валюта расчетов» - код валюты расчетов по сделке, порожденной данной заявкой. Поле редактируемое, доступно только для шлюза «Брокерские котировки».

Звездочкой (*) отмечены обязательные поля.

Поля «Количество», «Код клиента», «Ссылка», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 «Настройка автозаполнения полей ввода заявки».

Нажатием кнопки «Ввести» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

Заявка, принятая торговой системой, отображается в Таблице заявок на внебиржевые сделки.

7.11.3 Заполнение полей окна ввода заявки в режимах РЕПО и РЕПО-М

РЕПО: БК - Акции Ввод внебиржевой заявки РЕПО

Инструмент: ЛУКОЙЛ Торговый Счет: L01-00000F00

Операция: Покупка Продажа

Код расчетов: B0 Дата расчетов: 24.12.2019

Цена: 5000 Количество: 10 Лот: 1

Партнер: ИКСИ [NC0038900000]

Код Клиента: Q1 Поручение: Ссылка:

Возмещение: Цена выкупа: Ставка РЕПО: 5,5

Ввести Отмена

МБ ФР: РЕПО-М: Акции Ввод адресной заявки РЕПО

Инструмент: +МосЭнерго Торговый Счет: L01-00000F00

Операция: Покупка Продажа

Код расчетов: A0 Дата расчетов: 23.12.2019 ☐ Блокировать инструменты на время операции РЕПО

Сумма РЕПО: 17000 Количество: 100 Лот: 1

Дисконт (%) [начальный, нижний, верхний]: 5 4 3

Ставка РЕПО: 5,5 Срок РЕПО (0-180): 30 Возмещение:

Партнер: ИКСИ [NC0038900000]

Код Клиента: Q1 Поручение: Ссылка:

Ввести Отмена

1. «Инструмент» * - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
2. «Торговый счет» * - выберите из списка номер торгового счета, в отношении которого делается поручение (регрстр символов имеет значение).
3. «Операция» * - направление операции: «Покупка» или «Продажа».
4. «Код расчетов» - укажите вручную либо выберите из списка код расчетов по первой части сделки РЕПО (РЕПО-М). Возможные значения:

- «T0» или «Rb» - расчеты «сейчас»,
- «S0» - расчеты сегодня,
- «S01» - расчеты осуществляются в следующий торговый день,
- «S02» - расчеты осуществляются через один торговый день.
- «Z0» - расчеты осуществляются по правилам простого клиринга Московской Биржи.

Если поле не заполнено, принимается значение по умолчанию: «T0».

Для валютного рынка используются значения: «T0», «T1», «F1W», «F2W», «F1M», «F2M», «F3M», «F6M», «F1D-F180D».

5. «Дата расчетов» - дата расчетов по сделке для указанного инструмента и кода расчетов (информационное поле).
6. «Блокировать инструменты на время операции РЕПО» - признак блокировки инструментов. Выставленный флажок означает, что инструменты, приобретенные по первой части сделки РЕПО (РЕПО-М), блокируются в депозитарии до выполнения всех обязательств по сделке.
7. «Сумма РЕПО» * - объем сделки РЕПО (РЕПО-М) в денежном выражении.
8. «Количество» * - количество инструментов, выраженное в лотах.
9. «Лот» - количество инструментов в одном лоте. Информационное поле.

10. «Дисконт (%) начальный, нижний, верхний» - условие сделки РЕПО (РЕПО-М), которое может устанавливаться сторонами сделки РЕПО (РЕПО-М) при ее заключении:

- Начальное значение дисконта (Начальный дисконт) - условие сделки, указывается в заявке на заключение сделки в явном виде или однозначно определяется из условий заявки.
- Нижнее предельное значение дисконта - условие сделки, выражается в процентах. Если Дисконт становится меньше Нижнего предельного значения дисконта, у Первоначального продавца возникает обязательство по внесению Компенсационного взноса в денежной форме.
- Верхнее предельное значение дисконта - условие сделки, выражается в процентах. При превышении Дисконтом величины Верхнего предельного значения дисконта у Первоначального покупателя возникает обязательство по внесению Компенсационного взноса Облигациями.

11. «Ставка РЕПО» - процентная ставка платы за пользование ресурсами, в % годовых.

12. «Срок РЕПО (0-180)» - промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО (РЕПО-М). Срок исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки, до дня исполнения второй части сделки включительно.

13. «Возмещение» - ставка возмещения в случае просрочки исполнения обязательств по сделке РЕПО (РЕПО-М), выраженная в процентах. Во встречных заявках значение должно совпадать.

14. «Партнер» * - выберите из списка либо укажите вручную краткое наименование контрагента по сделке.

15. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.

16. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.

17. «Ссылка» - текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Если один из контрагентов заполнил это поле, то другой контрагент обязан ввести то же значение.

Звездочкой (*) отмечены обязательные поля.

Поля «Количество», «Код клиента», «Ссылка», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

Нажатием кнопки «Ввести» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

Заявка, принятая торговой системой, отображается в Таблице заявок на внебиржевые сделки.

7.11.4 Заполнение полей окна ввода адресной заявки в режиме РЕПО с ЦК

МБ ФР: РЕПО с ЦК адресное (Акции) Ввод адресной ...

Инструмент: ГАЗПРОМ ао

Торговый Счет: L01-00000F00

Операция: Покупка

Код расчетов: T0

Дата расчетов: 23.12.2019

Дисконт: 2

Сумма РЕПО:

Кол-во (лот 10): 40

Ставка РЕПО: 5

Срок РЕПО (0-180): 1

Ссылка:

Партнер: ИКСИ [NC0038900000]

Код Клиента: Q1

Поручение:

Ввести Отмена

1. «Инструмент» * - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
 2. «Торговый счет» * - выберите из списка номер торгового счета, в отношении которого делается поручение.
 3. «Операция» * - направление операции: «Покупка» или «Продажа».
 4. «Код расчетов» * - укажите вручную либо выберите из списка код расчетов по первой части РЕПО сделки. Возможные значения:
 - «T0» - расчеты «сейчас»;
 - «Y0» - расчеты осуществляются в текущий торговый день. Первая часть сделки заключается с частичным обеспечением;
 - «Y1» - расчеты осуществляются в следующий за датой заключения сделки торговый день;
 - «Y2» ... «Y7» - расчеты осуществляются на второй (и т.д. до седьмого) торговый день после даты заключения сделки.
 5. «Дата расчетов» - дата расчетов по сделке для указанного инструмента и кода расчетов (информационное поле).
 6. «Дисконт» ** - размер дисконта, в %.
 7. «Сумма РЕПО» ** - объем сделки в денежном выражении.
 8. «Кол-во (лот ...)»** - количество инструментов, выраженное в лотах. В скобках указано количество единиц выбранного инструмента в одном лоте.
- (**) Обязательно должны быть заполнены два поля из следующих полей:**
«Дисконт», «Сумма РЕПО», «Кол-во (лот ...)».
9. «Ставка РЕПО» * - процентная ставка платы за пользование ресурсами, в % годовых.
 10. «Срок РЕПО (0-180)» * - срок исполнения второй части РЕПО. Срок указывается с учетом выходных и праздничных дней.

11. «Ссылка» - текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Если один из контрагентов указал что-либо в этом поле, то другой контрагент обязан ввести то же самое.
12. «Партнер» * - выберите из списка либо укажите вручную краткое наименование партнера по сделке.
13. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
14. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.

Звездочкой (*) отмечены обязательные поля.

Поля «Кол-во (лот ...)», «Код клиента», «Ссылка», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

Нажатием кнопки «Ввести» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

Заявка, принятая торговой системой, отображается в Таблице заявок на внебиржевые сделки.

7.11.5 Заполнение полей окна ввода адресной заявки РЕПО Банка России с корзиной ценных бумаг

1. «Инструмент» * - название инструмента. Доступное значение «КорзинаЦБ».
2. «Торговый счет» * - выберите из списка номер торгового счета, в отношении которого делается поручение.
3. «Операция» * - направление операции. Значение: «Продажа», не редактируется.
4. «Приоритетное обеспечение» - выберите из списка приоритетный инструмент, принимаемый в обеспечение.
5. «Код расчетов» - укажите вручную либо выберите из списка код расчетов по первой части РЕПО сделки. Возможные значения:

- «DVP1» - расчеты осуществляются сразу после получения реестра сделок. НРД подбирает обеспечение, и при отсутствии или недостаточности ценных бумаг, подлежащих передаче по первой части сделки РЕПО, расчеты и подбор бумаг осуществляется каждые 30 минут;
- «DVP3» - расчеты осуществляются непосредственно перед каждым клиринговым сеансом.

6. «Сумма РЕПО» * - объем сделки в денежном выражении.
7. «Ставка РЕПО» * - процентная ставка платы за пользование ресурсами, в % годовых.
8. «Срок РЕПО» - срок исполнения второй части РЕПО.
9. «Партнер» * - выберите из списка либо укажите вручную краткое наименование партнера по сделке.
10. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
11. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.
12. «Ссылка» - текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Если один из контрагентов указал что-либо в этом поле, то другой контрагент обязан ввести то же самое.

Звездочкой (*) отмечены обязательные поля.

Поля «Код клиента», «Ссылка», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

Нажатием кнопки «Ввести» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

Заявка, принятая торговой системой, отображается в Таблице заявок на внебиржевые сделки.

7.11.6 Настройки программы, относящиеся к адресным заявкам

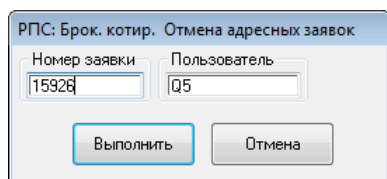
Настройки устанавливаются через пункт меню программы Система/Настройки/Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Заявки» / «Внебиржевые заявки»:

- «Подставлять текущую цену в заявку РЕПО» - если флажок установлен, то в поле «Цена» автоматически подставляется цена последней сделки на этот инструмент с соответствующего обычного класса.
- «Проверять цены на min-max для РПС, РЕПО» - проверять соответствие цены заявки РЕПО или РПС диапазонам допустимых значений «Мин.цена» и «Макс.цена» из Таблицы текущих торгов, установленных на основном классе инструментов. Например, для класса «РПС А1-Акции» основным классом является класс «А1-Акции». Если при этом какая-либо из цен диапазона нулевая, то ограничение с данной стороны не проверяется.



Функция «Автозаполнение» позволяет при формировании новой адресной заявки задавать соответствия между параметрами «Код клиента/Поручение» и «Класс/Инструмент / Операция». В результате, при выборе в форме ввода адресной заявки определенного инструмента и операции, в полях «Код клиента» и «Поручение» подставляются определенные значения. Настройки функционала «Автозаполнение» подробно описаны в п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

7.11.7 Отмена адресной заявки

Неисполненные отправленные адресные заявки со статусом «Активна» доступны для снятия. Полученные адресные заявки недоступны для отмены.





Снятие адресной заявки может быть осуществлено одним из следующих способов:

1. В Таблице заявок на внебиржевые сделки (снимаемая заявка должна быть выбрана):
 - Выбором пункта контекстного меню «Снять заявку на внебиржевую сделку»;
 - Двойным щелчком правой кнопки мыши на строке с заявкой;
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Нажатием клавиш «Ctrl»+«D».
2. Общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС: А1-Акции») и операции «Отмена адресных заявок». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т». В открывшемся окне укажите номер снимаемой заявки и код пользователя (необязательно).

7.11.8 Ввод безадресной заявки

Окно ввода новой безадресной заявки может быть вызвано одним из следующих способов:

1. В Таблице безадресных заявок на внебиржевые сделки (в таблице должна присутствовать хотя бы одна заявка):
 - Выбором пункта контекстного меню «Новая безадресная внебиржевая заявка» или пункта меню программы **Действия/Новая безадресная внебиржевая заявка**;
 - Двойным щелчком левой кнопки мыши на строке с заявкой;
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Нажатием клавиши «F2».
2. Общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС Акции 1-го уровня») и операции «Ввод безадресной заявки». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».

Форма ввода безадресной заявки для РПС (слева) и для сделок РЕПО (справа)

Заполнение полей окна ввода заявки:

1. «Код торгового счета» - код торгового счета, в отношении которого подается заявка.
2. «К/П» - направление операции: «Купля» либо «Продажа».
3. «Инструмент» - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
4. «Цена» - цена заявки, за единицу финансового инструмента.
5. «Количество» - количество инструментов, выраженное в лотах.
6. «Код расчетов» - укажите вручную код расчетов по сделке.
7. «Снять активные заявки» - если флажок установлен, то ранее введенная безадресная заявка по этому инструменту отменяется, а вводимая заявка будет единственной.
8. «Примечание» - текстовый комментарий к заявке.
9. «Ссылка» - текстовая строка, служащая для сопоставления встречных заявок в сделке. Если один из контрагентов указал что-либо в этом поле, то другой контрагент обязан ввести то же самое.
10. «Цена выкупа» - цена второй части РЕПО. Параметр ввода заявки РЕПО.
11. «Ставка РЕПО» - процентная ставка платы за пользование ресурсами, в % годовых. Параметр ввода заявки РЕПО.

Нажатием кнопки «Выполнить» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

Заявка, принятая торговой системой отображается в Таблице безадресных заявок на внебиржевые сделки и таблице «РПС котировки». Параметры лучших заявок по каждому инструменту отображаются в Таблице текущих торгов.

7.11.9 Заполнение полей окна ввода безадресной заявки в режиме РЕПО с ЦК

Окно в зависимости от настроек может иметь компактную (слева) или полную (справа) форму. Вид окна переключается нажатием кнопки «>>>». Формы оптимизированы для легкого и быстрого ввода параметров и компактного расположения на экране.

Заполнение формы заявки:

1. «Инструмент» - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
2. «Торговый счет» - выберите из списка номер торгового счета, в отношении которого делается поручение (регриср символов имеет значение).
3. Направление операции: «Покупка» или «Продажа».
4. «Цена» - цена заявки за одну единицу инструмента. При включении признака «Рыночная» значение поля «Цена» устанавливается равным «0» и недоступно для редактирования. При отключении признака «Рыночная» в поле подставляется значение цены, указанное до включения признака «Рыночная». При выборе в рамке «Ввод цены» значения «По средневзвешенной цене» поле «Цена» становится неактивным (серым).
5. «Рыночная» - признак заявки без указания цены исполнения. Такая заявка исполняется на бирже по ценам имеющихся встречных заявок, начиная с лучшей из них. Неисполненный остаток снимается с торгов.
При выборе в рамке «Ввод цены» значения «По средневзвешенной цене» признак «Рыночная» становится неактивным (серым).
6. «Кол-во» - количество инструментов, выраженное в лотах. Справа указано количество инструментов в одном лоте. Если заполнено поле «Сумма РЕПО», поле недоступно для редактирования и содержит значение предполагаемого количества.
7. «Сумма РЕПО» - объем заявки РЕПО в денежном выражении. Если заполнено поле «Кол-во», поле недоступно для редактирования и содержит значение предполагаемого объема.
8. «Код клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
9. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.

Дополнительные параметры:

10. «Ввод цены»:
 - Выбор значения в поле «Цена»:
 - «По цене» - исполнение заявки при наличии в торговой системе встречных заявок с аналогичной ценой исполнения.
 - «По доходности» - исполнение при наличии встречных заявок с аналогичной доходностью, рассчитанной по цене заявки (для облигаций).

- «По средневзвешенной цене» - в качестве цены принимается средневзвешенная цена за текущую торговую сессию.

При подаче безадресной заявки РЕПО с ЦК всегда выбирается вариант «По цене».

- Выбор цены исполнения заявки:
- «По одной цене» - заявка исполняется по одной цене.
- «По разным ценам» - заявка может быть исполнена по разным ценам.

11. «Условие исполнения» определяет порядок обработки остатка заявки при ее частичном исполнении:

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

По умолчанию заявка имеет условие «Поставить в очередь».

12. «Заявка маркет-мейкера» - признак подачи заявки маркет-мейкером.


Нажатием кнопки «Да» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.


- 1. При заполнении формы заявки можно перемещаться между полями мышью, либо клавишей «Tab» в одну сторону, или «Shift» + «Tab» в обратную сторону.**
- 2. Стрелки «вверх» и «вниз» в полях «Цена» и «Кол-во» служат для изменения значений в этих полях при помощи мыши. Одно нажатие левой кнопкой мыши на стрелке меняет значение на одну минимальную величину шага, а при нажатой клавише «Ctrl» – на 10.**
- 3. Поля «Количество», «Код клиента», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».**

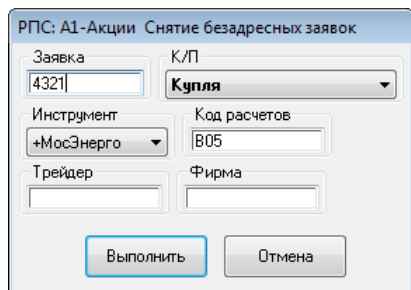
7.11.10 Отмена безадресной заявки

Неисполненные заявки со статусом «Активна» доступны для снятия. Снятие безадресной заявки может быть осуществлено одним из следующих способов:

- 1.** В Таблице безадресных заявок на внебиржевые сделки (снимаемая заявка должна быть выбрана):
 - Выбором пункта контекстного меню «Снять безадресную внебиржевую заявку» или пункта меню программы Действия/Снять безадресную внебиржевую заявку;

- Двойным щелчком правой кнопкой мыши на строке с заявкой;
- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Нажатием клавиш «Ctrl»+«D» на снимаемой заявке.

2. Общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС Акции 1-го уровня») и операции «Отмена безадресной заявки». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».



В открывшемся окне укажите параметры (звездочкой (*) отмечены обязательные поля):

1. «Заявка» * - номер заявки для снятия.
2. «К/П» - направление операции: «Купля» или «Продажа».
3. «Инструмент» * - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.
4. «Код расчетов» - укажите ручную либо выберите из списка код расчетов по сделке (значения: «Т0», от «В0» до «В31»).
5. «Треjder» - идентификатор трейдера, подавшего заявку.
6. «Фирма» - идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой подана заявка.

7.11.11 Редактирование заявок

Неисполненные (активные) заявки можно редактировать. Изменение условий в заявке выполняется путем снятия старой заявки и вводом новой с измененными условиями. Такую операцию можно выполнить следующим способом:

1. Двойным нажатием правой кнопки мыши на активной заявке - снять старую заявку.
2. Двойным нажатием левой кнопки мыши на снятой заявке - открыть окно ввода заявки с параметрами, аналогичными снятой.
3. Изменить нужные параметры заявки и отправить ее в торговую систему.


Изменение условий неисполненной заявки в «Таблице безадресных заявок на внебиржевые сделки» не требует снятия старой заявки и ввода новой с измененными условиями. Для редактирования безадресной внебиржевой заявки необходимо:

1. вызвать диалог редактирования заявки нажатием сочетания клавиш «Ctrl»+«А» или выбором пункта контекстного меню «Заменить безадресную внебиржевую заявку»,
2. изменить нужные параметры заявки и отправить ее в торговую систему.

7.11.12 Ввод расчетной заявки-отчета

Операция предназначена для ввода в Торговую систему отчетов об исполнении ранее заключенных сделок, содержащихся в таблице «Сделки для исполнения». Сделки, доступные для ввода отчёта, образуют список переговорных сделок, ещё не занятых в расчётах. В отчет включаются сделки из таблицы «Сделки для исполнения», отфильтрованные по наименованию класса, инструмента, счету депо, партнёру и торговому счёту партнёра. Транзакция может быть использована для пролонгации сделок РЕПО.

Подтверждение заявкой-отчетом может быть выполнено одним из следующих способов:

1. По одной заявке: из таблицы сделок для исполнения одним из следующих способов (в таблице должна присутствовать хотя бы одна заявка):
 - Выбором пункта контекстного меню «Подтвердить отчетом» или пункта меню программы **Действия/Подтвердить отчетом**;
 - Двойным щелчком левой кнопки мыши на строке с заявкой;
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Нажатием клавиши «F2».
2. От одной до четырех заявок: общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки **T** на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС: А1-Акции») и операции «Ввод расчетной заявки-отчета (макс. 4 сделки)». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».
3. От одной до девяноста девяти заявок: выбором пункта контекстного меню «Ввод заявки-отчета (макс. 99 сделок)» в Таблице сделок для исполнения.

Назначение полей формы ввода расчетной заявки-отчета:

Ввод расчетной заявки-отчета

Фильтры

☐ Класс

РЕПО-М: БК Акции

☐ Клиент

D3

☐ Счет депо

S01-00000F00

☐ Инструмент

ЛУКОЙЛ

☐ Партнер

NC0038900000

☐ Счет депо партнера

< Не указан >

☐ Только сделки с исполнением сегодня

NC0038900000

☐ № отчета партнера

102894

Доступные сделки для исполнения

Выделить все

Снять выделение

Количество сделок

3

Подтверждать срочным отчетом

Нетто количество

5

Отправить

Выход

Справка

Нетто сумма

-10 000,00

Фильтры:

1. «Класс» - выбор класса инструментов из списка.
2. «Инструмент» - выбор инструмента в данном классе.
3. «Клиент» - код клиента.
4. «Партнер» - код участника торгов, являющегося контрагентом по сделке.
5. «Счет депо» - код счета депо.
6. «Счет депо партнера» - код счета депо партнера.
7. «№ отчета партнера» - номер отчета партнера по сделке.
8. «Только сделки с исполнением сегодня» - фильтр по сделкам с наступившим сроком исполнения.

Настройки фильтров формы ввода расчетной заявки-отчета сохраняются в файл конфигурации (*.wnd).

Если в таблице «Сделки для исполнения» выделена строка со сделкой и из контекстного меню таблицы открыта форма «Ввод расчетной заявки-отчета», то поля формы: «Класс», «Инструмент», «Клиент», «Партнер», «Счет депо», «Счет депо партнера», «№ отчета партнера» заполняются значениями, указанными в этой сделке.

Для подтверждения сделок выберите их, отметив флажком в первой колонке. Нажатие кнопки «Выделить все» позволяет отметить все сделки в списке. Нажатием кнопки «Снять выделение» снимаются отметки со всех сделок.

Справочные поля:

1. «Количество сделок» отображает количество сделок, включенных в отчет.
2. «Нетто количество» - сальдо изменения позиции по инструментам в результате исполнения выбранных сделок.
3. «Нетто сумма» - сальдо изменения позиции по деньгам в результате исполнения выбранных сделок.

Если количество выбранных в таблице сделок превышает максимальное количество сделок, доступное для подтверждения в одной транзакции (4 сделки), то значения в полях «Нетто количество» и «Нетто сумма» очищаются, и в левой нижней части формы выводится предупреждение «Нетто-параметры не могут быть посчитаны».

4. «Подтверждать срочным отчетом» - признак исполнения в режиме расчетов по правилам простого клиринга.



Нажатием кнопки «Отправить» заявка-отчет отсылается в торговую систему. Нажатие кнопки «Выход» закрывает окно без отправления заявки.

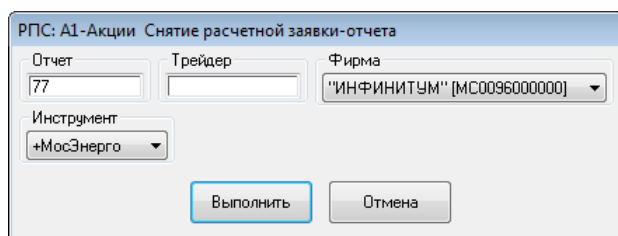
Заявка-отчет, принятая торговой системой, отображается в Таблице заявок-отчетов на сделки РПС. Соответствующая ей сделка в Таблице сделок для исполнения изменит статус с «Ждет исполнения» на «Включен в отчет». После того, как партнер по сделке подтвердит ее со своей стороны, статус изменится на «Исполнен» и сделка будет завершена.

7.11.13 Отмена заявки-отчета на исполнение сделок РПС

Неисполненные отправленные заявки-отчеты со статусом «Активна» доступны для снятия. Полученные заявки-отчеты для отмены недоступны.

Снятие заявки-отчета может быть произведено одним из следующих способов:

1. В Таблице заявок-отчетов на сделки РПС (снимаемая заявка должна быть выбрана):
 - Выбором пункта контекстного меню «Снять отчет» или пункта меню программы **Действия/Снять отчетом**;
 - Двойным щелчком правой кнопки мыши на строке с заявкой;
 - Нажатием кнопки  на панели инструментов;
 - Нажатием клавиш «Ctrl»+«D» на снимаемой заявке.
2. Общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС Акции 1-го уровня») и операции «Отмена безадресной заявки». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».




В открывшемся окне укажите параметры (звездочкой (*) отмечены обязательные поля):

1. «Отчет» * - Номер отменяемой заявки-отчета.
2. «Треjder» - идентификатор трейдера, подавшего заявку.
3. «Фирма» - идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой подана заявка.
4. «Инструмент» * - выберите название инструмента из списка инструментов данного класса.

7.11.14 Ввод заявки исполнения без подтверждения

Заявка исполнения без подтверждения используется для исполнения сделок одного дилера или между дилерами, когда не происходит уменьшение позиции партнера по деньгам и инструментам. Для исполнения сделки требуется ввод одной заявки исполнения. Сделка совершается в момент подачи этой заявки. При постановке заявок исполнения осуществляется контроль позиций по деньгам и инструментам. Заявка исполнения направляется в адрес только конкретного партнера. В заявке исполнения отражаются нетто-сумма и нетто-количество сделок, включенных в заявку.

Окно ввода новой заявки исполнения без подтверждения может быть вызвано общим способом выполнения транзакций - нажатием кнопки  на панели инструментов, выбором соответствующего класса (например «РПС: А1-Акции») и операции «Ввод отчета на исполнение без подтверждения». Эта же операция может быть выполнена горячей клавишей «Ctrl»+«Т».

Заполнение полей окна ввода заявки при вводе заявки исполнения без подтверждения общим способом выполнения операций (звездочкой (*) отмечены обязательные поля):

Форма ввода отчета на исполнение без подтверждения для РПС (слева)
и для сделок РЕПО-М (справа)

1. «Кол-во сделок» * - Количество заключенных сделок, подтверждаемых в отчете. Значения от 1 до 4.
2. «Сделка 1» * .. «Сделка 4» - идентификационные номера подтверждаемых сделок.
3. «Направленность сделки 1» * .. «Направленность сделки 4» - направление операции для соответствующей сделки: Купля или Продажа.

Нажатием кнопки «Выполнить» заявка отправляется в торговую систему. Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без отправления заявки.

7.12 Маклерская заявка

7.12.1 Назначение


Маклерская заявка - специальный вид транзакций, используемый в случае, когда один сервер QUIK используется несколькими участниками торгов для подключения к торговым системам бирж.

Маклерская заявка позволяет указать код участника торгов непосредственно при вводе поручений из числа брокеров, использующих данный сервер QUIK.

Работа с маклерскими заявками требует наличия на сервере специальной лицензии на использование мультиброкерских рабочих мест и настройки прав пользователя для работы с ними.

Открытие окна «Ввод маклерской заявки» осуществляется:

Из Таблицы текущих торгов, Таблицы котировок, Таблицы заявок, Таблицы сделок Таблицы «Купить/продать» выполнением следующих действий:

- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Двойным нажатием левой кнопки мыши. Из Таблицы текущих торгов подать заявку таким образом не получится, так как при выполнении этого действия откроется Окно котировок;
- Нажатием клавиши «F2»;

- Выбором в таблице пункта контекстного меню «Новая заявка» или пункта меню программы **Действия/Новая заявка**;
- Использованием Общего способа выполнения транзакций с выбором операции «Ввод маклерской заявки».

7.12.2 Ввод маклерской заявки

Окно в зависимости от настроек может иметь компактную (слева) или полную (справа) форму. Вид окна переключается нажатием кнопки «>>». Формы оптимизированы для легкого и быстрого ввода параметров и компактного расположения на экране.

Заполнение формы заявки:

1. «Организация» - идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой подана заявка. Заполняется автоматически, если указан «Код клиента».
2. «Инструмент» - выбор инструмента из списка инструментов данного класса. Чтобы найти инструмент в списке, наберите с клавиатуры первые буквы его наименования (контекстный поиск в выпадающих списках включается в меню Система/Настройки/Основные настройки..., раздел «Программа»).
3. «Торговый счет» - код торгового счета, в отношении которого подается заявка (регистр символов имеет значение). Если за пользователем закреплен один счет, то поле заполнится автоматически. Если доступны несколько счетов, потребуется выбрать нужный счет из списка или воспользоваться настройкой «Указывать счет депо по коду клиента» (см. п. 5.13.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента»). О настройке последовательности счетов в списке подробнее см. п. 5.14 Раздела 5 «Торговые операции клиента».
4. «Покупка» / «Продажа» - направление операции.
5. «Цена» - цена заявки за одну единицу финансового инструмента. При включении признака «Рыночная» значение поля «Цена» устанавливается равным «0» и недоступно для редактирования. При отключении признака «Рыночная» в поле автоматически подставляется значение цены, указанное до включения признака «Рыночная». При смене инструмента запомненное значение сбрасывается.
При выборе в рамке «Ввод цены» значения «По средневзвешенной цене» поле «Цена» и признак «Рыночная» становятся неактивными (серыми).

6. «Рыночная» - признак заявки без указания цены исполнения. Такая заявка исполняется на бирже по ценам имеющихся встречных заявок, начиная с лучшей из них. Неисполненный остаток снимается с торгов.
При выборе в рамке «Ввод цены» значения «По средневзвешенной цене» признак «Рыночная» становится неактивным (серым).
7. «Кол-во» - количество инструментов в заявке. Поле недоступно для заполнения при подаче рыночной заявки на покупку на аукцион периода закрытия.
8. «Код клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
9. «Поручение» - номер поручения.

Дополнительные параметры:

10. «Ввод цены»:

- Выбор значения в поле «Цена»:
 - «По цене» - исполнение заявки при наличии в торговой системе встречных заявок с аналогичной ценой исполнения.
 - «По доходности» * - исполнение при наличии встречных заявок с аналогичной доходностью, рассчитанной по цене заявки (для облигаций).
 - «По средневзвешенной цене» * - в качестве цены принимается средневзвешенная цена за текущую торговую сессию.

Как правило, почти всегда используется вариант «По цене», установленный в форме по умолчанию. Если для данного класса или типа заявки выбор невозможен, варианты становятся неактивными (серыми).

- Выбор цены исполнения заявки:
 - «По одной цене» - заявка исполняется по одной цене.
 - «По разным ценам» - заявка может быть исполнена по разным ценам.

11. «Объем и комиссия» - стоимость сделки в денежном выражении. Поле недоступно для заполнения при подаче рыночной заявки на продажу на аукцион периода закрытия. Размер комиссии рассчитывается автоматически и выводится в поле справа.
12. «Задать количество» - рассчитать значения полей «Объем» и «Комиссия».
13. «Условие исполнения» - порядок исполнения заявки: «Поставить в очередь», «Немедленно или отклонить», «Снять остаток», «Аукцион периода закрытия».

Поля «Количество», «Код клиента», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

7.12.3 Ввод маклерских заявок для классов Срочного рынка FORTS

Окно в зависимости от настроек может иметь компактную (слева) или полную (справа) форму. Вид окна переключается нажатием кнопки «>>». Формы оптимизированы для легкого и быстрого ввода параметров и компактного расположения на экране.

Форма ввода маклерской заявки для класса «Опционы FORTS»:

Форма ввода маклерской заявки для класса «Фьючерсы FORTS»:

Заполнение формы заявки:

1. «Организация» - идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой подана заявка. Заполняется автоматически, если указан «Торговый счет».
2. «Инструмент» - выбор инструмента из списка инструментов данного класса. Чтобы найти инструмент в списке, наберите с клавиатуры первые буквы его наименования (контекстный поиск в выпадающих списках включается в меню **Система/Настройки/Основные настройки...**, раздел «Программа»).
3. «Торговый счет» - код торгового счета, в отношении которого подается заявка (регистр символов имеет значение). Если за пользователем закреплен один счет, то поле заполнится автоматически. Если доступны несколько счетов, потребуется выбрать нужный счет из списка или воспользоваться настройкой «Указывать счет депо по коду клиента» (см. п. 5.13.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента»). О настройке последовательности счетов в списке подробнее см. п. 5.14 Раздела 5 «Торговые операции клиента».
4. «Покупка» / «Продажа» - направление операции.

5. «Цена» - цена заявки за одну единицу финансового инструмента. При выставлении заявки с признаком «Рыночная» требуется указать такую цену, не хуже которой должны исполняться заявки. При включении признака «Рыночная» в пустое поле «Цена» подставляется значение «Максимально возможная цена», а при подаче заявки на продажу - «Минимально возможная цена» для данного инструмента (значение берется из Таблицы текущих торгов). При отключении признака «Рыночная» в поле автоматически подставляется значение цены, указанное в данном поле до включения признака «Рыночная». При смене инструмента запомненное значение сбрасывается. При включении признака «Рыночная» значение поля устанавливается равным «0» и недоступно для редактирования. При отключении признака «Рыночная» в поле автоматически подставляется значение цены, указанное в данном поле до включения признака «Рыночная». При смене инструмента запомненное значение сбрасывается.
6. «Кол-во» - количество инструментов в заявке.
7. «Рыночная» - при установленном признаке и при наличии встречного предложения заявка исполняется по цене не хуже, чем значение, указанное в поле «Цена». Неисполненный остаток, на который отсутствует встречное предложение, снимается с торгов.
8. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
9. «Поручение» - номер поручения.

Дополнительные параметры:

10. «Условие исполнения» - порядок исполнения заявки: «Поставить в очередь», «Немедленно или отклонить», «Снять остаток».
11. «Переносить заявку» - признак выставления заявки с условием исполнения до даты, указанной пользователем.
При установленном признаке поле для выбора даты экспирации заявки становится доступным для редактирования.
12. «Проверять клиентский лимит» - при установленном признаке производится проверка лимитов клиента.
13. «Объем» - оценка заявки в денежном выражении. Позволяет рассчитать «Кол-во» инструментов в заявке по известной сумме денег. Для этого нужно ввести в поле «Объем» сумму денежных средств и нажать кнопку «Задать кол-во». При этом в поле «Кол-во» будет введено число, полученное в результате пересчета и округленное вниз до ближайшего целого, а в поле «Объем» - денежная оценка заявки при данном «Кол-ве».
Объем заявки рассчитывается по формуле:

$$\text{«Объем»} = \text{«Количество»} * \text{«Стоимость шага цены»} * (\text{«Цена»} / \text{«Размер шага цены»})$$

14. «Объем ГО» - совокупный размер ГО, который блокируется по заявке, исходя из количества контрактов и настроек брокера.
15. «Проверять диапазон цен» - если флажок включен, то цена заявки проверяется торговой системой на соответствие диапазону допустимых значений цены по этому инструменту. Признак доступен только для класса «Опционы FORTS».

Поля «Кол-во», «Код Клиента», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

7.12.4 Снятие и замена маклерской заявки

Операции снятия и замены маклерской заявки выполняются из Таблицы заявок и аналогичны действиям над обычными заявками.

7.13 Маклерская стоп-заявка


7.13.1 Назначение

Маклерская стоп-заявка - специальный вид стоп-заявки, используемый в случае, когда один сервер QUIK используется несколькими участниками торгов для подключения к торговым системам бирж. Маклерская стоп-заявка позволяет указать код участника торгов непосредственно при вводе поручений из числа брокеров, использующих данный сервер QUIK.

Работа с маклерскими стоп-заявками требует наличия на сервере специальной лицензии на использование мультиброкерских рабочих мест и настройки маклерских прав пользователя для работы с ними.

Открытие окна «Ввод стоп-заявки маклером» осуществляется:

Из Таблицы текущих торгов, Таблицы котировок, Таблицы заявок, Таблицы стоп-заявок, Таблицы сделок, Таблицы обезличенных сделок, Кармана транзакций выполнением следующих действий:

- Нажатием кнопки  на панели инструментов;
- Двойным нажатием левой кнопки мыши в «Таблице стоп-заявок»;
- Нажатием клавиши «F6»;
- Выбором в таблице пункта контекстного меню «Новая стоп-заявка» или пункта меню программы **Действия/Новая стоп-заявка**;
- Использованием Общего способа выполнения транзакций с выбором операции «Маклерская стоп-заявка».

7.13.2 Ввод маклерской стоп-заявки

С помощью формы ввода маклерской стоп-заявки можно формировать стоп-заявки разных типов (описание типов стоп-заявок см. п. 5.5.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента»). Дополнительные условия заявки отображаются в расширенной форме, вызываемой нажатием кнопки «Больше >>» или выбором типа стоп-заявки, для которой предназначены эти дополнительные условия.

Форма ввода маклерской стоп-заявки содержит следующие параметры:

МБ ФР: Т+ А1-Акции, паи и РДР Маклерская стоп-заявка

Организация: FIXSim7 [MC9222700000]

Тип стоп-заявки: Стоп-лимит

Срок действия: ☒ сегодня ☐ по 24.12.2019 ☐ до отмены

☐ Время действия: с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: +МосЭнерго Торговый Счет: L01-00000F00

Условие активации заявки: Покупка Продажа

тейк-профит, если цена <=
 стоп-лимит, если цена >= 4,3

Цена: 4,5 Кол-во (лот 1000): 15
☐ По рыночной цене max: 0

Код Клиента: Q1 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента: МБ ФР: Т+ А1-Акции, +МосЭнерго

Выставить связанную заявку:
 на покупку по цене
☒ При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит":
 Отступ от min в валюте цены
 Защитный спред в валюте цены
☐ По рыночной цене

Объем и комиссия: 67500,00 0,00
 Задать количество

Ввод Отмена Меньше <<

1. «Организация» - идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой подана заявка. Для срочного рынка заполняется автоматически, если указан «Торговый счет». Для спот-рынка заполняется автоматически, если указан «Код клиента».
2. «Тип стоп-заявки» - выбор одного из возможных типов поручения. Делает доступным особые поля, относящиеся к определенному типу стоп-заявки. При необходимости окно ввода заявки принимает расширенную форму.
3. «Срок действия». Если выбрано значение «сегодня», то поручение действительно до конца текущего дня, иначе поручение действительно до даты, выбранной в поле «по...», или до отмены поручения, если выбрано значение «до отмены».

Стоп-заявки «Со связанной заявкой» действительны только в течение текущей торговой сессии.

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

1. Параметр «Время действия заявки» определяет только интервал времени, в течение которого проверяется условие активации стоп-заявки. Если заявка активировалась, то проверка времени действия прекращается. Например, если для заявки типа «Тейк-профит и стоп-лимит» цена пробилла уровень тейк-профит (заявка сработала, начался расчет минимума/максимума цены), но заявка не исполнилась до окончания заданного интервала

времени внутри дня, то расчет максимума/ минимума цены не прекращается по истечении заданного периода времени.

2. Если значения времени «С...» и «До...» совпадают, то считается, что задан интервал с указанного времени текущего дня, до аналогичного времени следующего дня. Если значение «До...» строго больше времени «С...», то время действия проверяется в течение текущего дня.
3. При включенной настройке «Показывать дату и время торговых данных с учетом локальной временной зоны» (подробнее см. п. 2.10.1 Раздела 2 «Основные принципы работы с программой») значение параметра «Время действия заявки» указывается с учетом временной зоны компьютера, на котором запущен терминал QUIK.

5. «Инструмент» - выбор инструмента из списка инструментов данного класса. Чтобы найти инструмент в списке, наберите с клавиатуры первые буквы его наименования (контекстный поиск в выпадающих списках включается в меню Система/Настройки/Основные настройки..., раздел «Программа»).
6. «Торговый счет» - код торгового счета, в отношении которого подается заявка (регистр символов имеет значение). Если за пользователем закреплен один счет, то поле заполнится автоматически. Если доступны несколько счетов, потребуется выбрать нужный счет из списка или воспользоваться настройкой «Указывать счет депо по коду клиента» (см. п. 5.13.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента»). О настройке последовательности счетов в списке подробнее см. п. 5.14 Раздела 5 «Торговые операции клиента».
7. «Условие активации заявки» - настройка условий активации заявки:

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

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

8. «Цена» - цена лимитированной заявки, выставляемой в торговую систему при наступлении условия «Стоп-лимит», за одну единицу финансового инструмента.
При включении признака «По рыночной цене» значение поля устанавливается равным «0» и недоступно для редактирования. При отключении признака «По рыночной цене» в поле автоматически подставляется значение цены, указанное в данном поле до включения признака «По рыночной цене». При смене инструмента и отключении признака «По рыночной цене» значение цены не восстанавливается.

9. «По рыночной цене» - признак исполнения стоп-заявки по рыночной цене. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.

10. «Кол-во (лот ...)» - количество инструментов, выраженное в лотах. В скобках указано количество единиц выбранного инструмента в одном лоте.
11. «max» - максимальное возможное количество лотов в стоп-заявке, рассчитанное из величины доступных средств клиента с учетом всех комиссий. Нажатием на кнопку указанное максимальное значение вводится в поле «Кол-во». Поле отображается при включенном в настройках флажке «Рассчитывать доступное количество» (см. п. 5.13.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента»).
12. «Код Клиента» - идентификатор клиента в системе QUIK.
13. «Поручение» - текстовый комментарий к заявке.

Параметры расширенной формы ввода заявки, разворачивающиеся нажатием кнопки «Больше>>>»:

1. «Брать стоп-цену для инструмента» - наименование и класс инструмента, по которому осуществляется контроль условия стоп-цены. Параметр поручения типа «Стоп-цена по другому инструменту».
2. «Выставить связанную заявку на покупку (продажу) по цене» - цена исполнения связанной лимитированной заявки. Параметр поручения типа «Со связ. заявкой».
3. «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» - если флажок установлен, то при частичном исполнении связанной лимитированной заявки стоп-заявка становится снятой. Если флажок снят, то при частичном исполнении связанной заявки объем стоп-заявки уменьшается до величины неисполненного остатка лимитированной заявки.
4. «Выставить «тейк-профит» - параметры заявки типа «Тейк-профит»:
 - «Отступ от max (min)» - устанавливает значение отступа от максимума (на продажу) или минимума (на покупку) цены последней сделки, при достижении которого будет сгенерирована лимитированная заявка. Значение отступа может указываться как в виде отклонения цены, так и в процентах.
 - «Защитный спред» - устанавливает дополнительное (опережающее) отклонение цены заявки от цены последней сделки, инициировавшей заявку. Защитный спред предназначен для того, чтобы установить цену создаваемой лимитированной заявки заведомо исполнимой.
 - «По рыночной цене» - признак исполнения тейк-профита по рыночной цене. Значение параметра «Защитный спред» в данном случае не используется. Параметр заявок типа «Тейк-профит и стоп-лимит».

В некоторых режимах торгов использование рыночных заявок не предусмотрено.

5. «Объем и комиссия» - оценка заявки в денежном выражении. Позволяет рассчитать «Количество» инструментов в заявке по известной сумме денег. Для этого нужно ввести в поле «Объем» сумму денежных средств и нажать кнопку «Задать количество». При этом в поле «Количество» будет введено число, полученное в результате пересчета и округленное вниз до ближайшего целого, а в поле «Объем» - денежная оценка заявки при данном «Количестве»,

Сумма брокерской комиссии с объема заявки рассчитывается автоматически в соответствии с установленным алгоритмом и выводится в поле справа.

- 1. При заполнении формы заявки можно перемещаться между полями мышью, либо клавишей «Tab» в одну сторону, или «Shift»+«Tab» в обратную сторону.**
- 2. Поля «Количество», «Код клиента», «Поручение» могут быть заполнены автоматически. Подробнее см. п. 5.17 Раздела 5 «Торговые операции клиента».**
- 3. В случае неблагоприятного исполнения заявки типа «Тейк-профит» на покупку, цена будет рассчитана следующим образом: <стоп-цена> + <отступ от min/max> + <защитный спред>.**

Если для какого-то типа стоп-заявки не предусмотрен один из пунктов заявки, то он становится «серым» (неактивным).

Порядок подтверждения маклерской стоп-заявки, настройки параметров ее ввода, доступные функции и способ быстрого ввода такие же, как и при вводе заявки. Описание см. п. 5.2 Раздела 5 «Торговые операции клиента».

7.13.3 Снятие, замена и активация маклерской стоп-заявки

Операции снятия, замены и активации маклерской стоп-заявки выполняются из Таблицы стоп-заявок и аналогичны действиям над обычными стоп-заявками.

7.14 Участие в аукционах по размещению инструментов

Система QUIK поддерживает возможность участия в первичном размещении инструментов. Режим размещения инструментов предусматривает два этапа:

- 1. Ввод участниками торгов заявок на покупку размещаемого инструмента.**

Используемые таблицы:

- «Таблица текущих торгов» - информация о состоянии сессии, допускающем ввод заявок.
- «Таблица заявок» или «Таблица заявок на внебиржевые сделки» - собственные заявки на покупку инструментов.


- 2. Исполнение заявок клиентов андеррайтером.**

- «Таблица текущих торгов» - параметры состоявшегося размещения: объем, средневзвешенная, минимальная и максимальная цены сделок и т.п.
- «Таблица сделок» или «Таблица сделок для исполнения» - состояние исполнения собственных заявок.


При размещении инструментов Таблица котировок (очереди заявок), как правило, не используется.

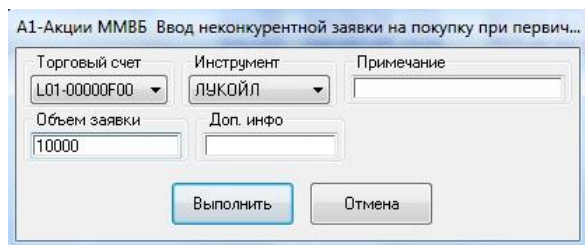
Размещение может проводиться двумя способами:

1. В форме аукциона, путем удовлетворения конкурентных и неконкурентных заявок.

- **Конкурентная заявка** - заявка с указанием цены. Ввод конкурентной заявки на аукционе осуществляется путем формирования лимитированной заявки на покупку (нажатием кнопки  на панели инструментов или клавиши «F2»).

Если в заявке указан тип значения цены «Доходность» или «Средневзвешенная цена», то при приеме заявки сервером QUIK проверка достаточности средств клиента не может быть осуществлена корректно в силу недостаточности информации из торговой системы.

- **Неконкурентная заявка** - заявка без указания цены, с условием исполнения по средневзвешенной цене удовлетворенных конкурентных заявок. Ввод неконкурентной заявки осуществляется Общим способом выполнения транзакций (нажатием кнопки  или клавиш «Ctrl»+«Т») и выбором операции «Ввод неконкурентной заявки на покупку при первичном размещении».



Данный тип транзакции недоступен для пользователей с правами Клиента.

В окне ввода заявки необходимо указать следующие параметры:

- «Торговый счет» - код счета депо, в отношении которого совершается сделка,
 - «Инструмент» - наименование инструмента,
 - «Примечание» - текстовый комментарий к заявке, необязательное поле,
 - «Объем заявки» - объем заявки в денежном выражении.
- 2. Размещение путем удовлетворения адресных заявок в Режиме переговорных сделок (РПС).**
Ввод заявки осуществляется путем формирования адресной заявки на покупку, направленной участнику торгов - андеррайтеру размещения инструментов с условиями, указанными в проспекте эмиссии, и интересующим количеством инструментов, выраженном в лотах.

7.15 Режим приема клиентских транзакций с подтверждением брокером

Данный режим предназначен для обработки поручений клиентов, по которым недостаточно автоматического контроля позиций клиентов и требуется предварительная проверка условий заявки сотрудником брокера.

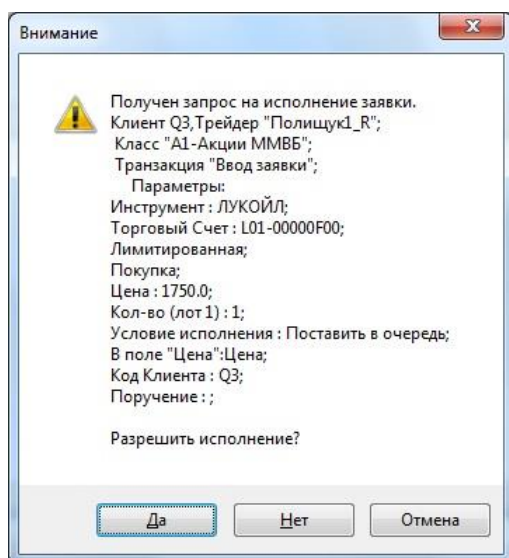
Режим приема клиентских транзакций с подтверждением брокером устанавливается Администратором системы QUIK и распространяется на все операции клиента по вводу и снятия заявок, относящихся к определенному классу инструментов.

Право на подтверждение заявок клиентов в данном режиме назначается Администратором системы QUIK пользователю с полномочиями Менеджера фирмы либо Субадминистратора (подробнее см. п. 7.3).

Таким правом могут обладать несколько сотрудников брокера. В случае принятия решения по одной заявке клиента несколькими сотрудниками брокера, принимается подтверждение, введенное первым.

7.15.1 Подтверждение заявки клиента

При получении сервером новой заявки клиента, требующей подтверждения, на рабочем месте пользователя QUIK с правом подтверждения клиентских заявок отображается окно, содержащее запрос на подтверждение транзакции с перечисленными в нем параметрами.



Нажатие кнопки «Да» подтверждает заявку клиента. Нажатием кнопки «Нет» заявка отвергается. Кнопка «Отмена» служит для закрытия окна без совершения действий с заявкой.

7.15.2 Настройки режима подтверждений

Окно настроек открывается выбором пункта меню Система/Настройки/Основные настройки..., раздел «Торговля» / «Заявки» / «Клиентские заявки» и имеет следующие параметры:

- «Запрашивать подтверждение при операциях с клиентскими заявками» - признак означает, что при выборе действия «Подтвердить клиентскую транзакцию» или «Отклонить клиентскую транзакцию» в контекстном меню «Таблицы запросов клиентов на исполнение клиентских заявок» (меню Создать

окно/Клиентские транзакции) на экране появится окно с подтверждением/отклонением клиентской заявки.

- «Запрашивать подтверждение при операциях с группами клиентских заявок» - признак означает, что при выборе действия «Подтвердить все кл. транзакции из таблицы» или «Отклонить все кл. транзакции из таблицы» в контекстном меню «Таблицы запросов клиентов на исполнение клиентских заявок» (меню **Создать окно/Клиентские транзакции**) на экране появится окно с подтверждением/отклонением клиентских заявок.
- «Показывать текст с описанием клиентской заявки в стандартном окне сообщений программы» - признак позволяет настроить получение оповещения о поступлении новой заявки. Если он включен, описание клиентской заявки отображается в Окне сообщений, если выключен - на экране появится диалог «Запрос на исполнение клиентской заявки» с дополнительным подтверждением выбранного действия.
 - «Активная кнопка в форме подтверждения клиентской заявки» - выбор кнопки в окне подтверждения клиентской заявки, являющейся активной при появлении окна на экране:
 - «Да» - подтвердить заявку,
 - «Нет» - отклонить заявку,
 - «Отмена» - закрыть окно без подтверждения заявки (действие может быть выполнено позднее или другим пользователем).

Свойство может применяться при частом подтверждении заявок, в этом случае достаточно пользоваться клавиатурой - нажатием клавиши «Enter» выполняется нажатие активной кнопки в окне.

7.16 Работа с неторговыми поручениями

7.16.1 Назначение

Система QUIK поддерживает работу с неторговыми поручениями, такими как ввод/вывод средств, переводы между площадками. Принцип их использования описан в п. 9.1 Раздела 9 «Неторговые операции и отчеты».

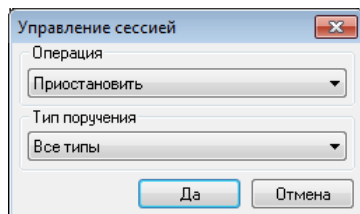
Прием и обработка поручений от клиентов осуществляется сотрудником брокера через Рабочее место QUIK с правами менеджера. Пользователь с правами менеджера имеет право на:

- Управление сессией - управление режимом приема поручений;
- Обработку поручений - подписание/отклонение поручений клиентов и взимание связанных с этим платежей.
- Изменение кросс-курса валют - указание кросс-курса валют, используемого в поручениях типа «Конвертация валют».

7.16.2 Управление сессией

меню Расширения / Неторговые поручения / Управление сессией

Неторговые поручения обрабатываются системой QUIK аналогично торговым транзакциям. Для того чтобы пользователи могли отправлять поручения брокеру, должна быть открыта сессия по классу «Неторговые поручения». Состояние сессии отображается в колонке «Сессия» Таблицы текущих торгов. Если необходимо временно остановить прием поручений (например, по техническим причинам), брокер может приостановить сессию для всех типов поручений или выбрать определенный тип поручения, для которого будет приостановлена сессия, выполнить необходимые процедуры, а затем возобновить сессию.



Операции, доступные в окне «Управление сессией»:

- «Открыть» - начать новую сессию,
- «Заккрыть» - завершить текущую сессию,
- «Приостановить» - временно приостановить текущую сессию,
- «Возобновить» - продолжить приостановленную ранее сессию,
- «Загрузка справочников» - произвести обновление справочников из базы данных Модуля неторговых поручений,
- «Загрузка поручений» - произвести обновление списка поручений из базы данных Модуля неторговых поручений.
- «Снять активные поручения» - снять активные поручения всех видов. Если в настройках Модуля задан список классов, по которым снимаются активные поручения в соответствии с расписанием, то операция применяется к указанному списку классов.
- «Остановить клиентскую сессию» - переводит открытую сессию в состояние «Служебная», которое означает невозможность отправки клиентами новых поручений, однако обработка поручений сотрудниками брокера не приостанавливается.
- «Возобновить клиентскую сессию» - переводит служебную сессию в состояние «Открыта».

7.16.3 Обработка поручений

Обработка поручений выполняется из «Таблицы поручений» (подробнее см. п. 9.2 Раздела 9 «Неторговые операции и отчеты»). В этой таблице отображаются поручения всех типов и состояние их обработки специалистами брокера. Двойным нажатием правой кнопки мыши на строке можно открыть поручение и посмотреть его параметры.

Номер	Клиент	Вид	Сумма	Состоя	Время рег.	Кли	Сумма пл	Риск-мен	Бухгалтер	Клиент. л	Бэк-офис	Деп
1	34412	Q7	Ввод ДС бе 1 000,00	Снято	10:33:12		0,00					
2	34413	Q7	plus Ввод ДС 500,00	Активнс	10:33:25		0,00					
3	34414	Q7	plus Ввод ДС 500,00	Активнс	10:33:27		0,00					
4	34415	Q7	Ввод ДС бе 1 000,00	Исполн	10:33:29		0,00	+	+	+	+	
5	34416	Q7	plus Ввод ДС 500,00	Активнс	10:37:20		0,00					
6	34417	Q7	plus Ввод ДС 500,00	Активнс	10:37:21		0,00					
7	34418	Q7	Ввод ДС бе 1 000,00	Исполн	10:37:22		0,00	+	+	+	+	
8	34419	Q7	Ввод ДС бе 1 000,00	Активнс	10:37:23		0,00					
9	34420	Q7	plus Ввод ДС 500,00	Активнс	12:09:47		0,00					

Состояние поручений в «Таблице поручений» выделено цветом шрифта:

- Активные - красным цветом,
- Исполненные - синим,
- Снятые - черным,
- Имеющие запрос на снятие - зеленым.

Для исполнения поручения необходимо подтверждение (подпись) уполномоченных сотрудников брокера. Последовательность проверки и количество необходимых подписей настраивается на сервере QUIK для каждого вида поручений.

Подписание поручения.

Чтобы подписать поручение, необходимо:

1. Открыть его двойным нажатием левой кнопки мыши на соответствующей строке в таблице.
2. Если пользователь имеет право на требуемую подпись, кнопка подписи будет активна и ее наименование будет соответствовать имени подписи на приведенном примере, это кнопка «Риск-менеджер». Также будут активны поля ввода налогов для соответствующей подписи.
3. Указать, если необходимо, значения удерживаемых платежей в соответствующих полях формы.
4. Нажать кнопку подписи (например, «Риск-менеджер»).

The screenshot displays the 'Поручение: Ввод ДС № 34422 от 22.11.2012 12:17:15 (Активно)' window. The form contains fields for 'Тип поручения' (Ввод ДС безналично), 'Рус_00 Срочность' (Новая), 'Рус_00 Код клиента' (Q7), 'Иванов. А.И.', 'Лицевой счёт' (00000000001234567890), 'Субсчёт', 'Банк получателя' (Рай фэйзен), 'Счёт: Рай фэйзен', 'БИК', 'Площадка' (RURSUR389), 'Сумма' (1000,00), 'Валюта' (RUR), 'Налог' (0,00), 'Комиссия депозитария' (0,00), and 'Комиссия за выд. нал.' (0,00). A modal dialog titled 'Поручения' is overlaid, asking 'Вы уверены, что хотите подписать поручение №34422' with 'Yes' and 'No' buttons. At the bottom of the main window are buttons for 'Риск-менеджер', 'Снять', and 'Закрыть'.

В результате на соответствующей строке в «Таблице поручений» появится отметка «+» в колонке с ролью данного сотрудника (например, «Риск-менеджер»), уведомляющая о наличии подписи.

Групповая подпись поручений.

Для осуществления групповой подписи надо в таблице поручений выбрать пункт контекстного меню «Подписать все поручения». Далее, в появившейся форме выбора подписей выбрать нужную подпись и нажать кнопку «Подписать». После нажатия кнопки «Подписать» будет осуществлен поиск поручений, которым требуется данная подпись. Найденные поручения подписываются с проверкой доступности ресурсов, как и при одиночной подписи.

Отклонение поручения.

Если поручение клиента не может быть исполнено, оно должно быть отклонено сотрудником брокера с указанием причины. Для этого необходимо:

1. Открыть его двойным нажатием левой кнопки мыши на соответствующей строке в таблице, либо выбрать пункт контекстного меню «Отменить».
2. В окне с поручением нажать кнопку «Снять».

В открывшемся окне «Комментарий к отмене поручения...» написать причину отказа, которая будет сохранена в данном поручении в поле «Комментарий отмены». Возможно заполнить причину отмены выбором шаблона из справочника «Причины отмены». По умолчанию шаблон не выбран. Текст причины можно изменять в форме отмены поручения.

В результате поручение в таблице примет состояние «Снято». При этом дальнейшая обработка поручения прекращается.

Отмена подписи.

Подпись поручения можно отменить из контекстного меню таблицы поручений:

- «Отзыв последней подписи» - отзывает последнюю подпись в сделке для данной роли.
- «Отзыв всех подписей» - отзывает подпись у всех сделок для данной подписи.

Также подпись можно отменить, открыв форму поручения и нажав кнопку «Отозвать».

Исполнение поручения.

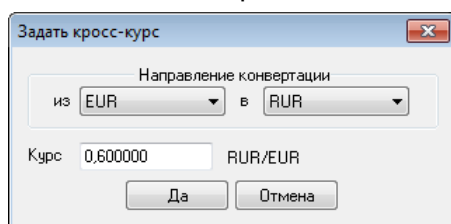
Поручение, имеющее все необходимые подписи, меняет статус на «Исполнено». При этом происходит изменение суммы заблокированных средств и доступных лимитов.

7.16.4 Изменение кросс-курса валют

меню Расширения / Неторговые поручения / Задать кросс-курс

Данное действие позволяет изменить кросс-курс валют, используемый в поручениях типа «Конвертация валют». Настройки в данном окне:

- В поле слева из справочника валют выбирается код валюты для указания кросс-курса.



- В поле справа выбирается код парной валюты, в единицах которой выражен кросс-курс.
- В среднем поле отобразится кросс-курс для указанной пары валют, указанный в справочнике Модуля неторговых поручений. Для изменения кросс-курса укажите в этом поле требуемое значение и нажмите кнопку «ОК».

Для закрытия окна без сохранения изменений нажмите кнопку «Cancel».

7.17 ПРИЛОЖЕНИЕ. Сообщения об ошибках при работе с позициями

1. «Ошибка в строке <номер строки> загружаемого файла <наименование файла>. Параметр <наименование параметра> имеет недопустимое значение <значение параметра>».
 - При загрузке позиций из файла обнаружена ошибка в синтаксисе. Проверьте правильность описания лимитов в указанной строке.
2. «Не удалось открыть файл позиций <имя файла>».
 - Невозможно открыть файл, указанный для загрузки позиций.
3. «Ошибка записи в файл».

- Сохранение позиций в файл невозможно. Убедитесь, что файл не занят другим приложением.
- 4.** «Нельзя запустить динамическую коррекцию позиций с учетом совершенных сделок».
- Ошибка выполнения операции. Свяжитесь с разработчиком программы для разрешения проблемы.
- 5.** «Невозможно открыть файл <имя файла>. Повторить попытку?»
- Файл с коррекциями позиций недоступен для чтения. Убедитесь, что он не занят другой программой.
- 6.** «Не указан <параметр> в коррекции позиции».
- Пропущен обязательный параметр в файле с коррекциями позиций.
- 7.** «Ошибка при открытии файла с журналом коррекции позиций».
- Файл с журналом коррекций позиций занят другим приложением либо недостаточно прав на создание/редактирование файла.
- 8.** «Коррекция неправильно заполнена».
- Данные в корректировке позиций не соответствуют друг другу. Например, код инструмента не соответствует счету депо.
- 9.** «<параметр> превышает допустимый размер».
- Превышен максимальный размер параметра. Убедитесь, что он указан правильно.
- 10.** «Указанный <параметр> не найден».
- Пропущен обязательный параметр корректировки позиций.
- 11.** «Неправильно указан <параметр> коррекции позиции».
- Значение параметра не соответствует допустимым значениям.
- 12.** «Нельзя начать отправку коррекции позиций из файла».
- Ошибка выполнения операции. Свяжитесь с разработчиком программы для разрешения проблемы.
- 13.** «Неверный формат файла коррекции позиций».
- Файл с коррекциями позиций имеет ошибочный формат. Убедитесь, что параметры разделены правильными разделителями, и каждая корректировка позиций описана отдельной строкой.
- 14.** «Не указан способ коррекции позиции».
- Пропущен обязательный параметр «LIMIT_OPERATION».
- 15.** «Неправильно указан способ коррекции позиции».
- Значение параметра «LIMIT_OPERATION» не соответствует допустимым значениям.