

Список изменений в ТК СPECTRA версии 6.4

1. Блокировка брокерской части клиентского сбора:

В системе SPECTRA реализован сервис блокировки брокерской комиссии на стороне биржи. Заблокированная комиссия учитывается на клиентском разделе, уменьшая свободные средства клиента (money_free) на величину заблокированной части. Блокировка осуществляется в течение торговой сессии, в вечерний клиринг блокировка сбрасывается. Брокерская комиссия отображается в торговом терминале Срочного рынка и транслируется в шлюзе в таблице part потока FORTS_PART_REPL (суммарно по клиенту), а также в потоке FORTS_BROKER_FEE_REPL (в разрезе сделок).

Брокерская комиссия определяется следующим образом:

$broker_fee = N \times \max(lower_fee, \min(upper_fee, \text{round}(\text{multiplier} \times ex_fee / N, 2) + additive))$, где

- N – количество контрактов в сделке;
- lower_fee – минимально возможная сумма брокерской комиссии за один контракт;
- upper_fee – максимально возможная сумма брокерской комиссии за один контракт;
- multiplier – мультипликатор к сумме биржевого и клирингового сбора;
- ex_fee – сбор (клиринговый + биржевой) за сделку с учетом скальперских скидок;
- additive – постоянная добавка за один контракт.

Параметры lower_fee, upper_fee, multiplier и additive задаются брокером в торговом терминале Срочного рынка или с помощью шлюзовой команды SetBrokerFeeParamNextSession. Параметры могут устанавливаться как для отдельного клиента, так и для всех клиентов БФ одновременно. Применение параметров происходит в следующую торговую сессию. Заданные пользователем параметры отображаются в торговом терминале Срочного рынка, и транслируются в шлюзе в потоке FORTS_BROKER_FEE_PARAMS_REPL.

2. Добавление оборота по опционной премии:

Начиная с версии 6.4 в ТК SPECTRA производится расчет суммарного по рынку оборота по опционной премии. Рассчитанное значение отображается в торговом терминале Срочного рынка и транслируется в шлюзе в таблице common (поле total_premium_volume) потока FORTS_OPTCOMMON_REPL.

3. Изменения в торговом терминале Срочного рынка:

- Для поддержки функционала блокировки брокерской части клиентского сбора: в окно Лимитирование добавлен новый параметр Брокерская комиссия, отображающий брокерскую комиссию;
- в окно Управление параметрами клиентов добавлены новые параметры, новые кнопки и панель инструментов, новые пункты в контекстное меню, позволяющие управлять брокерским сбором.
- В окно Финансовые инструменты добавлен новый параметр Оборот по премии, отображающий суммарный оборот по опционной премии.
- Добавлена возможность быстрой смены инструмента на другую дату исполнения с сохранением базового актива в окнах Котировок, Тех.анализ и Информация. В контекстное меню в пункт Сменить инструмент добавлен раскрывающийся список с перечнем доступных инструментов по тому же БА.

4. Изменения в пользовательском шлюзовом интерфейсе CGate:

- Добавлен новый поток FORTS_BROKER_FEE_REPL - Брокерские комиссии
- Добавлен новый поток FORTS_BROKER_FEE_PARAMS_REPL - Параметры для расчета брокерской комиссии



- В потоке FORTS_ PART_REPL в таблицу part добавлено поле: broker_fee (d26.2) - средства, заблокированные под брокерскую комиссию.
- В потоке FORTS_OPTCOMMON_REPL в таблицу common добавлено поле: total_premium_volume (d26.2) - суммарный оборот по премии.

5. Изменения в репозитории схем подачи команд:

- Удалена команда FutChangeBFParameters (msgid=95).
- Новая команда SetBrokerFeeParamNextSession (msgid=453) - Установка параметров для расчета брокерской комиссии:
 - broker_code (c4) – код брокера
 - mode (i4) – режим работы команды: 1 – добавить/изменить, 2 - удалить
 - client_code (c3) – код клиента
 - lower_fee (c27) – минимально возможная сумма брокерской комиссии за один контракт
 - upper_fee (c27) – максимально возможная сумма брокерской комиссии за один контракт
 - multiplier (c27) – мультипликатор к сумме биржевого и клирингового сбора
 - additive (c27) – постоянная добавка за один контракт

6. Изменения в протоколе FAST:

- FastGate транслирует инструменты в группах FUT-INFO и OPT-INFO по шаблону SecurityDefinition с id="17", в котором добавлено поле Flags, флаги инструмента:
 - 0x01 - Признак торговли в вечернюю сессию;
 - 0x10 - Признак анонимной торговли;
 - 0x20 - Признак неанонимной торговли;
 - 0x40 - Признак торговли в основную сессию;
 - 0x100 - Признак инструмента-связки;
- FastGate транслирует инструменты в группах SPOT-INFO и OTC-INFO по шаблону SecurityDefinition с id="17", в котором добавлено поле Flags и его значение равно 0.
- FastGate транслирует инструменты в группах IQS-FUT-INFO и IQS-OPT-INFO по шаблону SecurityDefinition с id="17", в котором добавлено поле Flags с признаком торговли инструментом в IQS-е. Флаги инструмента:
 - 0x800000 - Инструмент допускается в торги в индикативной системе котировок.
- Шаблон SecurityDefinition с id="16" выводится из использования и удаляется из templates.xml.
- В потоке анонимных заявок ORDERS-LOG в поле MDFlags транслируются два бита-признака:
 - 0x8000000000 - заявка или сделка системы IQS
 - 0x400000000000 - заявка или сделка системы RFS

