

Доработки в ТКС "SPECTRA" в рамках нового Указания 6681-У.

Описание

В рамках указания ЦБ 6681-У к Брокерам устанавливаются дополнительные требования по соблюдению нормативов НПР1 (норматив покрытия риска при исполнении поручения клиента, >0) и НПР2 (норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента >0). В рамках Указания предусматривается возможность использования "рыночного метода" для Участников, когда при расчете НПР-ов используется индикативная ВМ МБ для переоценки портфеля, и ГО МБ, расчёт которого осуществляется в соответствии с правилами расчета размера индивидуального клирингового обеспечения, требуемого для обеспечения обязательств, исполнение которых осуществляется за счет портфеля клиента.

Подготовка к новому регулированию в рамках Указания 6681-У: новый признак на 7кк – релиз 7.30.5.

Версия Spectra – 7.30.5.

- дата релиза на Т1 полигоне - 23 декабря 2024 года
- дата релиза в бою – 24 февраля 2025 года

Участникам предоставляется возможность заранее, до вступления в силу Указания заполнить категорию для всех своих конечных 7кк (значение по умолчанию – 0 (категория отсутствует)).

Новое

- Новый параметр 7кк - категория уровня риска - **client_risk_level**. Применение изменения категории в ближайший вечерний клиринг, для онлайн-регистрации на Срочном Рынке – категория применяется в момент регистрации болванки.
Если Участник не указывает для 7кк значение категории, то категория по умолчанию отсутствует и не присваивается.
- Справочник категорий, их обозначения:

Уровень клиента	client_risk_level
Не указано\По умолчанию	0
Клиент с Начальным Уровнем Риска (КНУР)	1
Клиент со Стандартным Уровнем Риска (КСУР)	2
Клиент с Повышенным Уровнем Риска (КПУР)	3
Клиент с Особым Уровнем Риска (КОУР)	4

Изменения во внешних интерфейсах

Сервис	client_risk_level
Сервис ЕРК (API + ЭДО)	<ul style="list-style-type: none">• Новое поле «Категория уровня риска клиента» "RISKLEVEL_TYPE" в операциях L (добавление) и U (изменение) кода, признак только для СР, новое поле обязательно для заполнения.

Сервис ЕРК (ЛКУ)	<ul style="list-style-type: none"> Новое поле в интерфейсе ЛКУ
Терминал Spectra	<ul style="list-style-type: none"> Таблица Лимитирование, уровень 7кк
Отчеты	<ul style="list-style-type: none"> Отчет clients, новое поле «Категория уровня риска клиента» CLIENT_RISK_LEVEL, i2
Шлюз Plaza2	<p>Новое поле «Категория уровня риска клиента»</p> <p>client_risk_level, i2:</p> <ul style="list-style-type: none"> поток FORTS_REFDATA_REPL, investor – в 7.30.5 поток FORTS_INFO_REPL, investor – в 8.0

Доработки в ТКС “SPECTRA” в рамках Указания 6681-У, новый сервис расчета ГО – релиз 8.0.

Версия Spectra – 8.0.

- дата релиза на Т1 полигоне - 27 января 2025 года
- дата релиза в бою – 24 марта 2025 года

Новое

1. ГО МБ.

Рассчитывается с **учетом категории клиента** (0, КНУР, КСУР, КПУР, КОУР – не задан*\начальный\стандартный\повышенный\особый уровень риска). При расчете клиентского ГО (на уровне 7кк) учитываются соответствующие категории риск-параметры («категорийные MR-ы»).

(*) Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов.

2. Расчет НПР-ов в рыночном методе

Осуществляется самим Участником с использованием выходных данных нового сервиса: **ГО б/з**, индикативная **BM, NOV** (Net Option Value) в соответствии с Указанием №6681-У:

$NPР = \text{начальная стоимость портфеля} + \text{текущая переоценка (с учетом BM, NOV)} - \text{ГО б/з}$.

При условии, что начальный лимит (money_amount) <= начальной стоимости портфеля, можно говорить о том, что биржевой пре-трейд (money_free>0) с учетом категории обеспечивает непобитие НПР1 (>0), посчитанного по рыночному методу в большинстве случаев*.

(*) По результатам расчетов различных тест-кейсов (более 200 вариантов портфелей).

Расчет **ГО б/з** осуществляется раз в 10 мин по всем 7кк, с трансляцией в новом потоке **FORTS_RMT_REPL**:

- без учета заявок
- с учетом категории клиента*
- с учетом текущего реализованного риска (упрощенно - с учетом текущей цены, как если бы позицию открыли прямо сейчас)
- по риск-параметрам **на начало сессии с учетом проведенных раздвижек**

(*) Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

"ГО б/з" - величина, рассчитываемая по **правилам расчета размера индивидуального клирингового обеспечения**, и соответствующая требованиям пп. 37 и 38 Приложения к Указанию.

Участник рассчитывает НПР-ы на своей стороне с использованием выходных данных нового сервиса (**ГО б/з**, индикативная **BM, NOV**).

НПР1 = начальная стоимость портфеля + BM + NOV- ГО б/з

НПР2 = начальная стоимость портфеля + BM + NOV- (ГО б/з)/2

3. "Текущий оперативный риск по позиции"

Дополнительная прогнозная величина, которая может быть использована Участником для принятия решений относительно позиций клиента.

Расчет осуществляется раз в 10 мин по всем 7кк, с трансляцией в новом потоке

FORTS_RMT_REPL:

- с учетом текущих риск-параметров и рыночных данных
- без учета заявок
- с учетом категории клиента*

(*) Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

"Текущий оперативный риск по позиции" - величина, рассчитываемая по правилам расчета размера индивидуального клирингового обеспечения, и соответствующая требованиям пп. 37 и 38 Приложения к Указанию и отражает размер ГО "если клиринг провести прямо сейчас".

Изменения во внешних интерфейсах

1. Новый информационный поток для трансляции величин ГО МБ без заявок и Текущего Оперативного риска FORTS_RMT_REPL

Поток содержит одну таблицу со значениями **ГО б/з**, **Текущего оперативного риска**, а также значениями **BM** (индикативной вариационного маржи) и **NOV** (Net Option Value). Сервис осуществляет расчет не менее одного раза в 10 минут на основе среза текущих данных по

- Риск-параметрам инструментов
- Позициям
- Текущим рыночным данным (цена, валютный курс).

Каждый срез данных идентифицируется своим ключом `rev_heartbeat` и его временем `im_time`. В потоке транслируется только последний актуальный расчет. Срез данных, использованный для расчета, сохраняется для истории и аудита в архиве.

Наименование	Тип	Описание
<code>sess_id</code>	i4	Идентификатор клиринговой сессии
<code>rev_heartbeat</code>	i8	Внутренний идентификатор расчета
<code>im_time</code>	t	Время расчета
<code>client_code</code>	c7	Код клиента
<code>client_risk_level</code>	i2	Категория уровня риска клиента
<code>rmt_im</code>	d16.2	ГО МБ без заявок с учетом текущего реализованного риска (учитывает текущую цену)
<code>rmt_posrisk</code>	d16.2	Текущий оперативный риск (дополнительная величина, по запросу Участников, не используется в расчете НПР, несет прогнозную

		функцию и отвечает на вопрос «какое будет ГО, если клиринг прямо сейчас»)
rmt_vm	d26.2	Индикативная вариационная маржа с учетом текущего индикативного курса валют, руб (рассчитывается аналогично текущей индикативной ВМ, учитывает в т.ч. вар.маржу по закрытым позициям)
rmt_nov	d26.2	Net Option Value, руб (текущий NOV по портфелю 7кк с учетом текущего курса и текущих цен опционов)

2. Изменения в имеющихся потоках

2.1. Поток FORTS_INFO_REPL, таблица investor

Наименование	Тип	Описание
client_risk_level	i2	Категория уровня риска клиента

2.2. Поток FORTS_INFO_REPL, таблица base_contracts_params

Наименование	Тип	Описание
mr1_erc	f	Значение ставки рыночного риска для КОУР*
mr2_erc	f	Значение ставки рыночного риска первого лимита концентрации для КОУР*
mr3_erc	f	Значение ставки рыночного риска второго лимита концентрации для КОУР
mr1_hrc	f	Значение ставки рыночного риска для КПУР
mr2_hrc	f	Значение ставки рыночного риска первого лимита концентрации для КПУР
mr3_hrc	f	Значение ставки рыночного риска второго лимита концентрации для КПУР
mr1_lrc	f	Значение ставки рыночного риска для КНУР
mr2_lrc	f	Значение ставки рыночного риска первого лимита концентрации для КНУР
mr3_lrc	f	Значение ставки рыночного риска второго лимита концентрации для КНУР
mr1_mrc	f	Значение ставки рыночного риска для КСУР
mr2_mrc	f	Значение ставки рыночного риска первого лимита концентрации для КСУР
mr3_mrc	f	Значение ставки рыночного риска второго лимита концентрации для КСУР

* Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

2.3. Поток FORTS_REFDATA_REPL, таблица opt_sess_contents

Наименование	Тип	Описание
base_im_covered_sell_erc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КОУР*
base_im_covered_sell_hrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КПУР
base_im_covered_sell_lrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КНУР
base_im_covered_sell_mrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КСУР
base_im_sell_erc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КОУР (руб)

base_im_buy_erc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КОУР (руб).
base_im_sell_hrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КПУР (руб)
base_im_buy_hrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КПУР (руб).
base_im_sell_lrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КНУР (руб)
base_im_buy_lrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КНУР (руб).
base_im_sell_mrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КСУР (руб)
base_im_buy_mrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КСУР (руб).

* Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

2.4. Поток FORTS_REFDATA_REPL, таблица fut_sess_contents

Наименование	Тип	Описание
buy_deposit_erc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КОУР* (руб)
sell_deposit_erc	d16.2	Базовое ГО продавца для КОУР (руб)
buy_deposit_hrc	d16.2	Базовое ГО покупателя (руб) для КПУР
sell_deposit_hrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КПУР (руб)
buy_deposit_lrc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КНУР (руб)
sell_deposit_lrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КНУР (руб)
buy_deposit_mrc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КСУР (руб)
sell_deposit_mrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КСУР (руб)

* Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

3. Отчет f07, dayf07, o07, dayo07

3.1. Отчеты o07 и dayo07.

Наименование	Тип	Описание
base_im_covered_sell_erc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КОУР*
base_im_covered_sell_hrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КПУР
base_im_covered_sell_lrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КНУР
base_im_covered_sell_mrc	d16.2	Базовое ГО под одну покрытую позицию подписчика (руб) для КСУР
base_im_sell_erc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КОУР (руб)
base_im_buy_erc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КОУР (руб).
base_im_sell_hrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КПУР (руб)
base_im_buy_hrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КПУР (руб).

base_im_sell_lrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КНУР (руб)
base_im_buy_lrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КНУР (руб).
base_im_sell_mrc	d16.2	Базовое ГО под одну непокрытую позицию подписчика для КСУР (руб)
base_im_buy_mrc	d16.2	Базовое ГО под покупку маржируемого опциона для КСУР (руб).

* Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов

3.2. Отчеты f07 и dayf07

Наименование	Тип	Описание
buy_deposit_erc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КОУР* (руб)
sell_deposit_erc	d16.2	Базовое ГО продавца для КОУР (руб)
buy_deposit_hrc	d16.2	Базовое ГО покупателя (руб) для КПУР
sell_deposit_hrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КПУР (руб)
buy_deposit_lrc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КНУР (руб)
sell_deposit_lrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КНУР (руб)
buy_deposit_mrc	d16.2	Базовое ГО покупателя для КСУР (руб)
sell_deposit_mrc	d16.2	Базовое ГО продавца для КСУР (руб)

* Если уровень риска не задан, используются значения ставок риска, установленные НКЦ без дополнительных коэффициентов